

# 市场概述

Market Overview

【晨报 20160815】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/08/15

## 1. 财经新闻

(1) 央行周末公布最新数据显示，我国 7 月末外汇占款由上月的 23.63 万亿下降至 23.44 万亿，7 月末外储余额与 6 月规模基本持平。

(2) 央行周五晚称，日前世界银行（国际复兴开发银行）获准在中国银行间债券市场发行特别提款权（SDR）计价债券，总规模为 20 亿特别提款权，结算货币为人民币，首期特别提款权计价债券将于近期发行。

(3) 财新昨日报道称，多家证监局近日向辖区内各公司债券发行人下发通知，要求各公司债发行人对公司债券信息披露、募集资金使用、财务会计等情况开展全面自查，要求成立由公司董事长担任组长的自查工作小组，编制自查工作底稿，并形成自查报告，于 9 月 30 日前上交，随后当地证监局将进行现场

检查。

(4) 保监会近日在行业内部下发紧急通知，要求各人身险公司报送 2016 年 1 月至 6 月万能险业务数据，主要填报各预期存续期限下的规模保费收入和产品情况，摸底资产负债匹配及利差等具体情况。资产负债错配风险、流动性风险及利差损风险也正是目前保监会聚焦的行业十大潜在风险之一。

## 2. 市场动态

(1) 上周五央行进行公开市场操作 900 亿，逆回购到期 900 亿，本周有 4650 亿逆回购到期，其中今日到期 1250 亿，周二到期 700 亿，周三到期 800 亿，周四到期 1000 亿，周五到期 900 亿，此外上周六有 755 亿央票顺延至今日到期。上周五早盘资金面延续前几日资金面紧张的状况，只有部分大行融出隔夜，7 天资金基本供需相对平衡，14 天及以上资

金供给充足，需求较少，午后机构涌出大量资金，甚至减低利率融出。隔夜、7天、14天回购收盘加权利率分别在2.0495%、2.464%、2.6778%，交易量较上个交易日降低17.40%。

(2) 据中国外汇交易中心数据，上周五在岸人民币兑美元夜盘收涨，北京时间23:30收报6.6329元，较上个交易日夜盘收盘价小幅上扬46点，在岸人民币兑美元全天成交量大幅回落至170.26亿美元。

### 3. 一级市场

今日银行间市场有16招行CD147（计划发行规模35亿，票面利率2.85%）等同业存单48只；16农发21（增2）（计划发行规模50亿）等金融债5只；16广

州地铁永续期债03（计划发行规模24亿）等企业债3只；16中粮MTN001（计划发行规模50亿）等中期票据8只；16中普天SCP002（计划发行规模30亿）等短期融资券17只；16金鹿1（A级计划发行规模6.83亿，B级计划发行规模1.21亿，C级计划发行规模2.14亿）等资产支持证券1只；共计84只债券发行，计划发行额981.78亿。

### 4. 评级变动

无

以上仅供参考，谢谢！

如果您对本文有任何评论和见解

请发电邮至：[shmarketing@cfets-icap.com.cn](mailto:shmarketing@cfets-icap.com.cn)

更多信息，请登录网站：[www.cfets-icap.com.cn](http://www.cfets-icap.com.cn)

**免责声明** 文中信息均来源于公开资料，上海国际货币经纪有限责任公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，内容和意见仅供参考。本文仅反映作者个人观点，并不代表公司的看法。