

市场概述

Market Overview

【晨报 20160315】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/03/15

1. 财经新闻

(1) 昨日公布的央行最新数据显示，2 月央行口径人民币外汇占款下降 2279 亿元，至 23.98 万亿元，外汇占款连续四个月下降，但降幅大幅收窄近六成。其中，1 月央行口径人民币外汇占款下降 6445 亿元，创历史第二大降幅。

(2) 财政部昨日公布数据称，2016 年全国一般公共预算收入 15.72 万亿，比 2015 年预算执行数增长 3%；预算支出 18.07 万亿，剔除地方上年使用结转结余及调入资金后同口径增长 6.7%；赤字 2.18 万亿，比上年增加 5600 亿元。

(3) 据财新昨日报道，部分公募基金公司近日接国家外管局邮件问询摸底 QDII 产品，包括换汇情况、向基金公司了解对目前外汇压力的看法等。人民币汇率经历一段时间的大幅贬值，资本流出较多，QDII 额度也随之紧俏；外汇局因此增加了对资本流出节奏的把控。

(4) 财新今日报道称，近期监管部门组织深圳近 20 家银行召开房地产信贷监管的有关会议，强调房地产信贷风险，抑制投机性需求。监管部门拟对部分房地产贷款增速过快的银行，对于其房贷业务的合规等情况开展专项审计和检查。从上海、深圳两地银行业人士处获悉，监管将要求银行更好把握首付的资金来源，强调首付应是自有资金，而非信用贷款、消费贷款等，严格审核客户的信贷记录及资金来源。

(5) 欧元区昨日公布最新数据显示，1 月欧元区工业产出同比 2.8%，为 2011 年以来最高，大幅超过预期值 1.6%和前值-1.3%。欧元区 1 月工业产出环比 2.1%，为 2009 年 9 月以来最高，超过预期值 1.7%和前值-1%。

2. 市场动态

(1) 昨日央行进行公开市场操作 100 亿，逆回购到期 300 亿，资金净回笼 200

亿，今日同样有 300 亿逆回购到期。昨日市场早盘即有大行和股份制机构融出隔夜资金，9 点半以后市场隔夜融出相对减少。整体而言，昨日流动性充足，资金面整体稳定，略有紧张情绪，7 天利率小幅回升，跨季期限资金加权利率略涨，质押式逆回购交易量上较个交易日略有增加，预计央行继续小量逆回购操作，近期资金面以稳为主。

(2) 在岸人民币兑美元昨日夜盘走低，据中国外汇交易中心数据，在岸人民币兑美元夜盘交易中跌幅有所扩大，北京时间 23:30 交易结束时收报 6.5015 元，较上个交易日夜盘结束时下跌 0.13%；在岸人民币兑美元全天成交量上升至 196.4 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 江苏债 08（计划发行规模 105.5 亿）等地方政府债 8 只；16 浦发 CD117（计划发行规模 30 亿，

票面利率 2.85%）等同业存单 59 只；16 国开 09（增发）（计划发行规模 60 亿）等金融债 6 只；16 唐山金控债（计划发行规模 16 亿）等企业债 6 只；16 威宁 MTN001（计划发行规模 5 亿）等中期票据 8 只；16 连云港 SCP002（计划发行规模 5 亿）等短期融资券 24 只；16 信融（1A1 计划发行规模 5 亿，1A2 计划发行规模 10.8 亿，1B 计划发行规模 0.78，1C 计划发行规模 2.63 亿）等资产抵押证券 1 只；共计 115 只债券发行，计划发行额 2460.91 亿。

4. 评价变动

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

更多信息，请登录网站：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。