

市场概述

Market Overview

【晨报 20160509】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/05/09

1. 财经新闻

(1) 央行周六公布最新数据显示，中国 4 月外汇储备 32196 亿美元，预期 32040 亿美元，前值 32126 亿美元。中国 4 月外汇储备环比小幅上升 70 亿美元，3 月份环比增加 102.8 亿美元，为连续第二个月回升，也是 2014 年 6 月以来首次出现连续两个月环比上升。而以特别提款权（SDR）为计价单位的外汇储备数据出现缩水，4 月末按 SDR 计价的外汇储备为 2.27 万亿，较 3 月份减少 86.91 亿。

(2) 海关总署周日公布数据显示，4 月份我国进出口总值 1.95 万亿元，同比微降 0.3%。出口 1.13 万亿元，增长 4.1%；进口 8275 亿元，下降 5.7%，贸易顺差 2980 亿元，扩大 45.8%。美元口径下，4 月进口同比下降 10.9%，出口同比下降 1.8%，贸易顺差 455.6 亿美元。总体而言，4 月我国对外贸易降温，出口低于预期，进口意外大降，贸易顺差大幅

提高，前四个月，欧盟、美国和东盟仍为我国前三大贸易伙伴。

(3) 央行周六发布一季度中国货币政策执行报告，下一阶段继续实施稳健的货币政策，保持灵活适度，适时预调微调；进一步完善人民币汇率市场化形成机制；推动更多符合条件的境外发行人在银行间市场发行人民币债券。

(4) 上周五晚公布的美国 4 月新增非农 16 万人，为 7 个月以来最低，不及预期的 20 万；4 月失业率为 5%，差于预期 4.9%，前值 5%；4 月平均每小时工资同比 2.5%，略高于预期的 2.4%，前值为 2.3%。

(5) 中国城建周五晚发布公告称，因实际控制人变更导致触发债券协议中的提前赎回条款，公司将通过交割系统通知债券持有人提前赎回原应 2017 年到期的 25 亿元人民币债券。

(6) 南京雨润周五晚发布公告称，

中票“13 雨润 MTN1”到期本息兑付存在不确定性；该期中票总规模 10 亿元人民币。

2. 市场动态

(1) 上周公开市场央行净回笼资金 2200 亿，本周公开市场有 3600 亿逆回购到期，其中，今日无逆回购到期，周二、周三有 1000 亿逆回购到期，周四到期 1300 亿，周五到期 300 亿。上周银行间隔夜 shibor 从 2.0033% 回落至 2.0000%，7 天期 shibor 从 2.3400% 回落至 2.3260%。上周在央行逆回购+PSL 的操作下，资金面依然保持宽松的态势，流动性较为充足，shibor 短端利率逐日小幅下跌，长端变动幅度不大，回购利率整体也呈现下降趋势。

(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交易中继续上涨，北京时间 23:30 收报 6.4904 元，较上个交易日夜盘结束时上涨 0.27%，在

岸人民币兑美元全天成交量下降至 153.4 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 兴业 CD235（计划发行规模 44 亿，票面利率 2.97%）等同业存单 40 只；16 农发 16（增 2）（计划发行规模 100 亿）等金融债 3 只；16 恒健债 01（计划发行规模 20 亿）等企业债 1 只；16 中建材 MTN001（计划发行规模 40 亿）等中期票据 4 只；16 广控 SCP001（计划发行规模 30 亿）等短期融资券 9 只；共计 57 只债券发行，计划发行额 714 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。