

市场概述

Market Overview

【晨报 20160118】

文/ Linda Zu

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/01/18

1. 财经要闻

(1) 12 月中国外汇占款减少 7082 亿元。中国人民银行 15 日发布的数据显示，12 月末央行人民币外汇占款由上月末的 25.56 万亿元下降至 24.85 万亿元，当月减少 7082 亿元，创历史最大降。

(2) 央行开展 1000 亿 MLF 操作。中国央行周五对 9 家金融机构开展中期借贷便利操作 (MLF) 共 1000 亿元，期限 6 个月，利率 3.25%。

(3) 2015 年金融统计数据出炉。12 月末，广义货币增长 13.3%，狭义货币增长 15.2%。全年人民币贷款增加 11.72 万亿元，人民币存款增加 14.97 万亿元。12 月份银行间市场同业拆借月加权平均利率 1.97%。12 月末，国家外汇储备余额 3.33 万亿美元。

(4) 2016 年首单主权熊猫债出炉。加拿大不列颠哥伦比亚省公告称计划于 1 月 21 日 (下周四) 发行 30 亿元人民币

“熊猫债”，期限三年；中国银行和汇丰银行 (中国) 为该期债的联席主承销商；发行人为加拿大的一个自治主权省政府，具有标准普尔 AAA 级和穆迪 Aaa 级信用评级。

(5) 12 月新增贷款低于预期。中国 12 月新增人民币贷款 5978 亿元，预期 7000 亿元，前值 7089 亿元。中国 12 月社会融资规模 1.82 万亿元，预期 11500 亿元，前值从 10200 亿元修正为 10181 亿元。

2. 市场动态

(1) 资金面继续收紧。上周五隔夜质押式回购加权平均利率为 1.9360%，周四为 1.9300%；7 天品种为 2.3295%，上日为 2.3202%。

(2) 上周五利率债整体上行，国债曲线收益率涨跌互现。早盘国债新发 3m、6m，招标收益率较前一日市场收益率偏低。截止日终，国开行整体上行 1-3BP，

政策性银行曲线（农发行和进出口行）

以上仅供参考，谢谢！

除个别期限外，整体上行 3-5BP。

3. 评级变动

无

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。