

市场概述

Market Overview

【晨报 20160707】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/07/07

1. 财经新闻

(1) 外汇交易中心昨日公告称，自2016年8月15日起，进入银行间外汇市场的境外金融机构在境外与其客户开展远期卖汇业务产生的头寸在银行间外汇市场平盘后，按月对其上一月平盘额交纳外汇风险准备金，准备金率为20%，准备金利率为零。

(2) 银监会昨日起草了《银行业金融机构全面风险管理指引（征求意见稿）》。意见提出，银行全面风险管理应当覆盖各项业务条线，覆盖所有分支机构和所有风险种类，应制定清晰的风险管理策略，每年评估其有效性，应将风险管理策略、偏好、限额等报送银监机构。

(3) 针对人民币汇率指数为什么不断走贬，外汇交易中心昨日发文解释称，人民币汇率指数小幅贬值主要是受市场

供求变化的影响，一方面中国企业“走出去”意愿进一步升温，另一方面美联储加息仍有不确定性。此外，人民币汇率指数贬值还与基期因素有关，同时受我国物价水平略有走高的影响。为保持人民币实际有效汇率相对稳定，人民币名义有效汇率则存在一定贬值要求。

(4) 今日凌晨，美联储公布6月FOMC会议纪要显示，官员们指出美国劳动力市场的不确定性在增加，金融稳定性低威胁到前景展望。美联储认为，在加息之前，应谨慎地等待更多数据和英国脱欧情况。美联储官员们在如何加息、经济展望、通胀等方面存在较大分歧。

(5) 美国供应管理协会周三公布数据显示，美国6月ISM非制造业指数56.5，高于预期的53.3，亦高于5月的52.9，创七个月新高。分项数据中，就业指数、新订单指数和商业活动指数全

面上升。此外昨日公布的美国 6 月 Markit 服务业 PMI 终值 51.4，高于预期值 51.3 和初值 51.3，Markit 综合 PMI 终值 51.2，较初值持平。

2. 市场动态

(1) 昨日央行进行公开市场操作 300 亿，逆回购到期 2100 亿，今日有 1300 亿逆回购到期。昨日资金面依旧十分宽松，早盘开市后各大类型机构融出各期限资金，不久后即有减点隔夜融出，午盘后宽松态势依旧不减，银行间隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.0250%、2.4008%、2.6621%，交易量较上一个交易日增长 11.74%。

(2) 据中国外汇交易中心数据，昨日夜盘在岸人民币兑美元大幅收跌，北京时间 23:30 收报 6.6959 元，较上日夜盘收盘价下跌 143 点，为连续第五个交易日下跌，在岸人民币兑美元全天成交量小幅缩窄至 199.99 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 北京债 02（计

划发行规模 114.88 亿）等地方政府债 2 只；16 招行 CD110（计划发行规模 30 亿，票面利率 2.88%）等同业存单 72 只；16 进出 07（计划发行规模 50 亿）等金融债 2 只；16 南川城投债（计划发行规模 12 亿）等企业债 3 只；16 国开投 MTN001（计划发行规模 30 亿）等中期票据 4 只；16 华能集 SCP002（计划发行规模 40 亿）等短期融资券 12 只；16 华驭 4（A 级计划发行规模 26.32 亿，B 级计划发行规模 1.35 亿，C 级计划发行规模 2.18 亿）等资产抵押证券 2 只；共计 103 只债券发行，计划发行额 1237 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。