

市场概述

Market Overview

【晨报 20160603】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/06/03

1. 财经新闻

(1) 上海银监局副局长周文杰昨日表示，根据银监会年初下发的通知，上海正推进金融机构进行表外业务自查行动，关注点在于银行是否将表外业务纳入全行授信监控，目前这项工作正在开展当中。

(2) 欧洲央行昨晚决议维持主要再融资利率 0% 不变，维持隔夜存款利率 -0.4% 不变，维持隔夜贷款利率 0.25% 不变，所有均符合市场预期，此外，上调 2016 年欧元区 GDP 增长预期，上调 2016 年通胀预期。欧洲央行发布行长德拉吉表示，预计利率将在更长时期内保持在低位，每月购买 800 亿欧元资产的计划将持续实施至 2017 年 3 月底，将在 6 月 8 日启动购买企业债券的计划，目前欧元区经济复苏受到新兴市场的阻碍，预计将推出更多刺激措施，他同时强调在经济刺

激措施生效之前，需要保持耐心。

(3) 美国财长 Jack Lew 今早表示，如果中国被视为在干预外汇，以不公平方式获取优势，那么干预将产生严重后果，可能破坏中美之间的关系；尽管中国在汇率市场化方面已取得进展，但美国在要求中国向汇率市场化迈进方面不会心慈手软。

(4) 美国昨晚公布最新数据显示，5 月 ADP 就业人数增加 17.3 万，符合预期，前值 15.6 万修正为 16.6 万。新增就业岗位完全来自于服务业，制造业减少了 3000 个工作岗位。今晚美国劳工部将公布 5 月的非农就业数据以及失业率等重要数据。

(5) 证券时报昨晚报道称，中金所正研究制定放开股指期货限制的具体方案，股指期货市场的恢复将采取逐步松绑形式，初期将仅对特殊法人客户放宽

限制，具体包括放开非套保日内开仓手数限制及下调保证金。

2. 市场动态

(1) 昨日央行进行公开市场操作 700 亿，逆回购到期 750 亿，今日有 950 亿 7 天逆回购到期。昨日银行间市场资金面依旧宽松，隔夜及七天回购利率小幅回落，机构资金融出相对比较充足。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.0213%、2.3716%、2.624%，交易量较上一个交易日小幅增加 0.9%。

(2) 据中国外汇交易中心数据，昨晚在岸人民币兑美元夜盘扭转昨日白天的涨势，北京时间 23:30 收报 6.5821，较上个交易日夜盘收盘价跌 16 点，在岸人民币兑美元全天成交量小幅提升至 248.07 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 贴现国债 25

(计划发行规模 100 亿) 等国债 1 只；16 湖北债 16 (计划发行规模 150 亿) 等地方政府债 6 只；16 招行 CD099 (计划发行规模 10 亿，票面利率 2.78%) 等同业存单 75 只；16 信达租赁债 01 (计划发行规模 20 亿) 等金融债 2 只；16 西发债 01 (计划发行规模 15 亿) 等企业债 4 只；16 宁熊猫 MTN001 (计划发行规模 10 亿) 等中期票据 4 只；16 港中旅 SCP001 (计划发行规模 15 亿) 等短期融资券 12 只；共计 104 只债券发行，计划发行额 1380.00 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。