

半月市场要闻

(2019.08.16—2019.08.31)

目录

一、市场热点

1. 郑商所：大力推进短纤、瓶片、PX 等品种上市，推进 PTA 期权上市
2. 科创板开市以来，融券业务持续火爆，融券盘规模一路走高

二、最新动态

1. 全国银行间同业拆借中心发布 LPR 利率互换曲线和利率互换估值
2. 2019 年 8 月份共有 10 家公司获 IPO 批文

市场热点

1. 郑商所：大力推进短纤、瓶片、PX 等品种上市，推进 PTA 期权上市

在近日举办的 2019 中国（郑州）国际期货论坛 PTA 分论坛上，郑州商品交易所（简称“郑商所”）相关负责人表示，未来郑商所将大力推进短纤、瓶片、PX 等产业链品种研发上市，打造聚酯产业链期货品种板块，助力聚酯产业稳健运行。对于 PTA 期货，上述负责人指出，PTA 是第一个引入境外交易者的化工品种。截至 8 月底，PTA 期货共有 115 个境外客户开户，境外客户持仓量突破 1 万手，共有 29 家境外经纪机构完成备案。未来，郑商所将稳步推进 PTA 期货引入境外交易者工作，支持期货公司在境外举办推介会，加大服务全球聚酯产业力度，加快推进 PTA 期权上市。交通银行总行金融机构部相关负责人表示，PTA 产业链上下游产品的国际贸易量大，且主要贸易国家分布在“一带一路”沿线。在人民币国际化和期货市场对外开放的背景下，PTA 期货引入境外交易者，将进一步推动我国成为全球聚酯产品的定价中心，提升国际影响力。

2. 科创板开市以来，融券业务持续火爆，融券盘规模一路走高

据中国基金报 2019 年 8 月 18 日消息，不少机构频频出现券源紧张、融券价格飙升的情况。而在两融新交易规则的政策利好推动下，券商对两融类资本中介业务布局的积极性也不断提高。据券商人士透露，目前券商两融业务的自主性和自由度不断提升，多数证券公司也在积极招兵买马、调整部门资源投入到资本中介业务中，未来两融占券商业务的比重也会进一步抬升。

最新动态

1. 全国银行间同业拆借中心发布 LPR 利率互换曲线和利率互换估值

全国银行间同业拆借中心近日公告称，为满足市场成员对于贷款市场报价利率（LPR）利率互换的估值需求，全国银行间同业拆借中心从 9 月 2 日起发布 LPR 利率互换曲线和利率互换估值。LPR 利率互换曲线包括 LPR1Y（季付）利率互换曲线、LPR5Y（季付）利率互换曲线。LPR1Y（季付）的标准期限包括 6M、9M、1Y、2Y、3Y、4Y、5Y、7Y、10Y，LPR5Y（季付）的标准期限包括 6M、9M、1Y、2Y、3Y、4Y、5Y、7Y、10Y，利率互换曲线于 12:10、16:40 各发布一次。每类曲线发布报买、报卖和均值三条曲线。

数据源方面，利率互换曲线数据样本是 X-Swap 报价。12:10 曲线取样时间为

11:45-12:00, 16:40 取样时间为 16:15-16:30。在取样时间段每隔 30 秒选取一个取样点（例如收盘曲线取样点为 16:15:30、16:16:00、...、16:30:00），每个取样点选取 X-Swap 报价，计算出每个取样点的报买、报卖和均值价格。对 30 个取样点按均值排序并过滤上下各 25% 价格后，将剩余报价按照报买和报卖价差倒数为权重加权，计算出可成交报价的报买、报卖和均值利率。利率互换估值方面，支持 LPR1Y、LPR5Y 为标的利率的利率互换估值。LPR 利率互换曲线的发布渠道包括市场数据发布系统（CMDS）、市场数据报表系统（CMDR）、邮件。LPR 利率互换估值的发布渠道包括交易后处理平台（PTPP）、邮件。

2. 2019 年 8 月份共有 10 家公司获 IPO 批文

2019 年 8 月 30 日晚间，证监会宣布核准安徽省交通建设股份有限公司、东莞市宇瞳光学科技股份有限公司的首发申请。至此，8 月份 IPO 批文发放完毕。当月批文发放节奏平稳，保持每周 2 张批文的速度，共核发批文 10 张，数量较 7 月有所回升。

过会率方面，发审委 8 月份共审核首发申请 9 家，其中仅广东泰恩康医药股份有限公司未获通过，其余 8 家均过会，过会率达 88.9%，较 7 月 64% 的过会率有所提升。