周会

# 一、市场表现回顾

## 1.主要资产类别回顾

## 2.主要板块回顾

# 二、市场供需情况

## 1.资金流向：

**EM Flows Weekly:** elevated inflows continue across both EM retail bond and equity funds

|  |
| --- |
|  |

* EM bond flows were +$2.9bn (+0.58% of weekly AUM, ↑from +$2.7bn); EM equity flows were +$5.6bn (+0.43% of weekly AUM, ↓from +$6.5bn).

图 1: EM Fund Weekly (US Mn)

图 2: EM Retail Bond Fund Flows: Summary

图 3: EM-Dedicated Retail Bond Fund Beta: By currency exposure

图 4: US Corporate Mutual Fund Flow

图5：美联储资产负债表每周变化

## 2.新发行：

### 1)境内新发债：

### 2)境外新发债：

* 图 6: 新发行明细
* 图 7: 按评级分布
* 图 8: 按行业分布
* 图 9: 按期限分布
* 图 10: 境外每周新发及到期统计

# 三、观点讨论

# 四、模拟组合表现及持仓

## 1.模拟组合表现：

表 1: 模拟组合表现

## 2.核心组合表现及持仓：

表 8：A Non China持仓

# 五、组合风险分析

表 9： Portfolio Risk Metrics

# 六、核心组合表现