

市场概述

Market Overview

【晨报 20161216】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/12/16

1. 财经新闻

(1) 新华社连发六文评论美联储加息。美联储加息后，新华社昨日连发六篇文章述评，文章称，美国需考虑其货币政策的溢出效应，应就宏观政策与其他主要经济体进行协调。就当前经济体量及美元主导地位而言，美国已从其他地区获益匪浅，饮水要思源。文章还指出，美元还会升值，人民币对美元汇率还会走弱，但这并不妨碍人民币保持在全球的货币地位；同时，不应过分夸大加息对中国楼市的影响。

(2) 日本反超中国成美国海外最大“债主”。美国财政部的报告（TIC）显示，中国 10 月所持美国国债规模下降 413 亿美元，为连续第六个月下降，至 1.1157 万亿美元，创下 2010 年 7 月份以来新低。而日本 10 月所持美国国债下降 45 亿美元，至 1.13 万亿美元，反超中国，

成为美国第一大“债主”。

(3) 货币基金全部平安度过昨日的债市大跌，昨日国债期货一度跌停，货币基金赎回风声紧张，根据上证报的统计，全部 293 只货币基金的当日收益全部红盘，货基安全度过债市大跌这一天。但有部分货币基金的万份基金单位收益出现明显走低，呈现低空飞过的情況。

(4) 英国央行按兵不动。周四英国央行宣布，维持关键利率 0.25% 不变，同时维持资产购买规模 4350 亿英镑不变，符合市场预期。英国央行预计未来 6 个月内通胀率达到 2%。行长卡尼表示，将采取一切必要措施确保通胀预期维持稳定。

(5) 美元指数十四年来首次站上 103 关口。美联储鹰派加息影响之下，美元指数自 2003 年 1 月 6 日来首次站上 103 关口。欧元兑美元跌至近十四年来最低

水平，日元则跌至逾十个月新低，现货黄金跌破 1130 美元/盎司，白银下跌超 4%。

2. 市场动态

(1) 央行公开市场操作周四进行 1400 亿 7 天期、450 亿 14 天期以及 600 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 1000 亿，今日有 1350 亿逆回购到期；周四早盘资金面依旧趋紧，大型机构融出较少，偏紧状态持续至尾盘，跨年与跨春节资金需求依旧较大。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.4847%、3.3606%、3.6807%，交易量较上一交易日减少 8.36%。

(2) 周四债市交投活跃，各个期限收益率大幅上行。10 年国开活跃券 160210 最新报价在 3.885%/3.88%，上个交易日尾盘报价在 3.71%/3.68%。10 年期国债期货主力合约 T1703 报收 94.555 元，跌 1.16%；5 年期国债期货主力合约 TF1703 报收 97.595 元，跌 1.81%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周四在岸人民币兑美元夜盘时段走弱，并跌破 6.94 关口，北京时间 23:30 收报 6.9478 元，创 8 年新低，较上一个交易日夜盘收盘价大幅下挫 408 点，在岸人

民币兑美元全天成交量回落至 274.87 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 贴现国债 56 (计划发行规模 100 亿) 等国债 2 只；16 农行 CD040 (计划发行规模 2 亿，票面利率 3.88%) 等同业存单 92 只；16 农发 18 (增 19) (计划发行规模 40 亿) 等金融债 9 只；16 东北袜业项目 NPB01 (计划发行规模 4 亿) 等企业债 1 只；16 厦国集 MTN001 (计划发行规模 20 亿) 等中期票据 4 只；16 中铝业 SCP012 (计划发行规模 20 亿) 等短期融资券 8 只；16 中誉 2 (优先级计划发行规模 4.18 亿，C 级计划发行规模 1.97 亿) 等资产支持证券 1 只；共计 118 只债券发行，计划发行额 1032.65 亿。

4. 评级变动

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。