

市场概述

Market Overview

【晨报 20161013】

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2016/10/13

1. 财经新闻

(1) 发改委近日印发了《促进民间投资健康发展若干政策措施》，提出将研究制定“地方政府偿还欠款计划”，对于依法依规应由地方政府偿还的拖欠企业的工程款、物资采购款、保证金等，督促地方政府制定分期还款计划。根据方案，政府要认真履行承诺，遵守与企业、投资人签订各类合同协议，基于公共利益确需改变承诺和约定的，严格按照法律程序进行。

(2) 美联储今早发布 9 月会议纪要，部分委员希望加息，部分委员希望等待，数名委员认为将在不久加息；数名委员认为风险依旧偏向下行；有关劳动力市场的观点各不相同，很多委员认为劳动力市场依旧存在部分疲软；美联储官员预计“相对很快加息”；9 月决定等待是势均力敌的决议；部分票委认为，谨慎

加息的做法有助于就业市场复苏；少部分票委担心决议声明中对“目前”推迟加息的表述感到担忧。

(3) 英国央行有效汇率指数跌至纪录低点——英镑兑一篮子主要货币贸易加权汇率 10 月 11 日跌至该数据自 1990 年开始编制以来的最低水平，此间英镑兑美元本月贬值了超过 5%，因市场担忧英国恐放弃欧盟单一市场准入导致英镑跌幅加深。10 月 12 日英国首相 May 决定让议会就其脱欧计划表决，英镑一度有所反弹。

(4) 路透今早报道称，欧洲央行可能会在下周货币政策会议上讨论技术性调整其资产购买计划，但可能要到 12 月份才会针对 QE 计划作出相关决定、届时还将决定是否延长“当前定于 2017 年 3 月份结束的 QE 计划”；妥协性建议可能包括欧洲央行按成员国比例购买，有限

度地购买收益率低于存款利率的债券（欧洲央行当前排除此类债券），以及购买更大比重的任何个体成员国发行的债券。

（5）周三，美国劳工部数据显示，8月 JOLTS 职位空缺 544.3 万人，为 2015 年 12 月以来最低，大幅不及预期的 575 万人，7 月数据从 587.1 万人修正为 583.1 万人。

2. 市场动态

（1）周三央行公开市场进行 300 亿 7 天期、100 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 2050 亿；今日有 800 亿逆回购到期，此外有 1010 亿 6 个月期限 MLF 到期。昨日早盘资金面整体均衡偏松，开盘股份制城商融出隔夜，需求基本午前就可以得到满足，但全天下来资金不如前几个交易日宽松。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.1399%、2.4125%、2.5617%。交易量较上一交易日增加 8.97%。

（2）据中国外汇交易中心数据，周三在岸人民币兑美元夜盘时段弱势延续，北京时间 23:30 收报 6.7200 元，较前一个交易日夜盘收盘价下挫 15 点，在岸人

民币兑美元全天成交量回落至 223.80 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 湖南债 11（计划发行规模 250 亿）等地方政府债 3 只；16 招行 CD203（计划发行规模 2 亿，票面利率 2.83%）等同业存单 109 只；16 进出 11（计划发行规模 50 亿）等金融债 4 只；16 锦江国际 MTN002（计划发行规模 17 亿）等中期票据 5 只；16 扬州化工 CP001（计划发行规模 2 亿）等短期融资券 16 只；16 唯盈 2（A1 级计划发行规模 10 亿，A2 级计划发行规模 24.56 亿，C 级计划发行规模 5.44 亿）等资产支持证券 1 只；共计 140 只债券发行，计划发行额 1735.90 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。