

市场概述

Market Overview

【晨报 20160922】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/09/22

1. 财经新闻

(1) 北京时间周四凌晨 2 点，美联储公布 9 月 FOMC 声明。美联储 9 月按兵不动，符合预期，称要等待更多证据。不过美联储指出年内加息概率增加，点阵图显示年内或加息一次。本次会议上有三名委员投反对票，认为 9 月应加息，表明美联储内部分歧非常大。

(2) 美联储主席耶伦在新闻发布会中重申此前联储会议声明的观点称，目前经济并未过热，本次会议按兵不动是为看到更多就业和通胀好转的证据；只要就业形势持续这样改善，而且没有产生重大风险，她预计今年能加息一次；美联储决策不受政治影响，11 月大选前夕并非不可能加息。

(3) 外汇交易中心昨日公布，四家境外央行类机构进入中国银行间外汇市场，包括约旦中央银行、巴基斯坦国家

银行、阿拉伯货币基金组织和伊拉克中央银行。这四家机构均于当日获批成为中国银行间外汇市场会员，但各家可参与交易的权限有所不同。约旦中央银行可从事即期及远期交易；巴基斯坦国家银行和阿拉伯货币基金组织可从事即期、远期、掉期及货币掉期交易；伊拉克中央银行可从事即期交易。

(4) 近日，中国证券投资基金业协会下发通知，摸底基金公司 T+0 业务。协会要求，基金公司对旗下提供 T+0 快速赎回服务的产品情况进行梳理，根据自身情况设计压力测试方案，建立合适的模型对旗下 T+0 快速赎回服务的产品流动性、财务压力等方面进行评估。显然，该文件主要针对的就是以余额宝为主的货币基金创新产品。

2. 市场动态

(1) 周三央行进行 2000 亿公开市场

操作，其中 7 天期 1200 亿，28 天期 800 亿，逆回购到期 800 亿，今日有 200 亿逆回购到期。周三早盘资金面偏紧，延续本周前几个交易日资金状态，少数机构高价融出七天，14 天以及更长期限。14 天、21 天这样的跨季资金颇受关注，下午三点过后资金面逐渐宽松，慢慢隔夜供给充足。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.2725%、2.6823%、2.7331%。成交量较上一交易日小幅减少 2.9%。

(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小幅走强，北京时间 23:30 收报 6.6660 元，较前一个交易日夜盘收盘价上涨 45 点，在岸人民币兑美元全天成交量回升至 272.54 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 浦发 CD362（计划发行规模 107.50 亿，票面利率 3.00%）

等同业存单 123 只；16 阳光人寿债（计划发行规模 60 亿）等金融债 2 只；16 荆经开专项债（计划发行规模 7.70 亿）等企业债 5 只；16 营口港 MTN002（计划发行规模 15 亿）等中期票据 9 只；16 国电集 SCP005（计划发行规模 30 亿）等短期融资券 15 只；共计 154 只债券发行，计划发行额 1889.60 亿。

4. 评级变动

上调“14 沪永业债”债项评级由 AA+ 至 AAA（鹏元资信）；

上调上海永业企业（集团）有限公司主体评级由 AA 至 AA+（鹏元资信）；

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。