

市场概述

Market Overview

【晨报 20160928】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/09/28

1. 财经新闻

(1) 中国人民银行昨日表示，10月1日，人民币将正式加入IMF特别提款权(SDR)货币篮子，近期一些国际金融组织、境外央行等境外央行类机构和金融机构增加境内人民币债券资产的配置，中国银行间债券市场相关服务机构将继续提供便利。

(2) 周二，国家外汇管理局有关负责人就2016年6月末外债数据有关问题答记者问称，6月末，我国全口径外债余额环比增长2%，初步逆转了去年二季度以来外债总规模持续下降态势，表明外债去杠杆进程接近尾声。预计我国外债规模将随着外债管理改革措施的落地实施而进一步企稳。

(3) 美联储副主席 Stanley Fischer 昨日称，对美国政策利率过低表示担忧，但不主张大幅加息。他认为劳动力参与

率下降主要是经济衰退以前就存在的结构性原因，暗示他觉得美国经济无需美联储追加货币刺激。

(4) 周二欧洲银行类股票再次陷入动荡，促使该地区债券市场表现出现分化。德国10年期国债收益率跌2个基点，至-0.14%，盘中刷新7月份以来低点至-0.16%，芬兰国债收益率首次跌破零关口——10年期芬兰国债收益率跌2个基点至-0.012%。意大利10年期国债收益率上涨2个基点，类似到期日的葡萄牙国债收益率上涨3个基点。

(5) 昨日晚间，A股上市公司中钢国际发布最新公告称，公司收到控股股东中国中钢集团公司的通知，在国家政府部门的指导、支持下，在各相关方的共同努力下，中钢集团债务重组方案正式获得批准。中钢集团或成为本轮债务重组当中首家推行债转股的国有企业。

2. 市场动态

(1) 周二央行进行 800 亿公开市场操作，其中 14 天期 700 亿，28 天期 100 亿，逆回购到期 1800 亿，今日有 1500 亿逆回购到期。周二市场资金面整体平衡偏紧，较上一个交易日流动性进一步收紧，早盘，隔夜和跨季资金融出量明显减少，隔夜至 14 天资金需求旺盛，盘中有不少高价回购资金融出，直至中午收盘仍有大量隔夜和跨季需求没有得到满足，缺口直至临近尾盘才得到填补。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.2714%、2.5695%、2.9557%。成交量较上一交易日减少 6.00%。

(2) 据中国外汇交易中心数据，周二在岸人民币兑美元夜盘时段微幅走弱，北京时间 23:30 收报 6.6695 元，较前一个交易日夜盘收盘价持平，在岸人民币兑美元全天成交量放大至 257.17 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 新疆债 32（计划发行规模 9.80 亿）等地方政府债 8 只；16 民生 CD272（计划发行规模 25 亿，票面利率 2.85%）等同业存单 72 只；16 中瑞恒远债（计划发行规模 5.60 亿）等企业债 1 只；16 南昌城投 MTN002（计划发行规模 20 亿）等中期票据 3 只；16 鲁钢铁 SCP005（计划发行规模 10 亿）等短期融资券 10 只；共计 94 只债券发行，计划发行额 717.50 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。