

# 市场概述

Market Overview

【晨报 20161213】

文/ Ryan Rui

CFETS-ICAP 2016/12/13

## 1. 财经新闻

(1) 有关“人民币贬值”说法具有高度误导性。人民日报今早刊文称，人民币在全球货币体系中仍表现出稳定强势货币特征，中国经济基本面不支持人民币贬值。2015年以来，人民币国际化步伐不断加快，目前在全球主要金融中心均建立了人民币离岸交易中心，越来越多国家采用人民币结算国际贸易，人民币汇率可预测性不断提高。

(2) 欧盟将首度公布英国脱欧谈判方案。彭博今早报道称，除英国以外的27个欧盟国家领导人将于12月15日在布鲁塞尔峰会后晚宴中展开战略谈判，并将发布声明以阐明谈判的主要准则。虽然在晚宴后发布的公报将不涉及实质性的政策细节，但它将规定欧盟在未来两年内的方向。

(3) 美联储会议前美债收益率连续

三日上涨。美联储即将在今晚起召开为期两日的会议，市场普遍预测此次美联储会加息一次。美债收益率连续第三日连涨，10年期美债收益率升至2.478%，一度触及27个月最高收盘水平。30年期美债收益率升至3.162%，也录得2015年7月以来最高水平。2年期美债收益率升至1.145%，创下年内第二新高。

(4) 大连机床集团“16大机床SCP001”未足额划付付息兑付资金。上清所昨日发布公告称，2016年12月12日是大连机床集团有限责任公司2016年度第一期超短期融资券（16大机床SCP001）的付息兑付日。截至今日日终，我公司仍未足额收到大连机床集团有限责任公司支付的付息兑付资金，暂无法代理发行人进行本期债券的付息兑付工作。

## 2. 市场动态

(1) 央行公开市场操作周一进行 800 亿 7 天期、300 亿 14 天期以及 200 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 1300 亿，今日有 1150 亿到期；周一资金面总体持续上周的宽松态势，具体来看，早盘开盘就各家机构纷纷融出隔夜、7 天资金，大行非银均有融出，大部分缺口迅速被填平，14 天及 21 天资金融出相对较少；跨年 1 个月资金需求较大，但是融出较少，多为 4.50%左右的高价融出。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.269%、2.6103%、2.87%，交易量较上一交易日减少 0.79%。

(2) 周一债市开盘交投热烈，期货跌破预期，全天收益率向上。10 年国开活跃券 160210 最新报价在 3.5575%/3.55%，上个交易日尾盘报价在 3.49%/3.44%。10 年期国债期货主力合约 T1703 报收 96.685 元，跌 1.05%；5 年期国债期货主力合约 TF1703 报收 99.010 元，跌 0.48%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周一在岸人民币兑美元夜盘时段维持震荡，略有走强，北京时间 23:30 收报 6.9086

元，较上一个交易日夜盘收盘价下挫 30 点，在岸人民币兑美元全天成交量升至 369.75 亿美元。

### 3. 一级市场

今日银行间市场有 16 光大 CD309（计划发行规模 65 亿，票面利率 3.55%）等同业存单 104 只；16 国开 13（增 14）（计划发行规模 60 亿）等金融债 6 只；16 川煤气化项目 NPB02（计划发行规模 5 亿）等企业债 1 只；16 建发集 MTN001（计划发行规模 10 亿）等中期票据 6 只；16 苏交通 SCP020（计划发行规模 20 亿）等短期融资券 8 只；共计 125 只债券发行，计划发行额 1298.60 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](mailto:shmarketing@cfets-icap.com.cn)

更多信息, 请登录网站: [www.cfets-icap.com.cn](http://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。