

市场概述

Market Overview

【晨报 20161206】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/12/06

1. 财经新闻

(1) **新华社指出特朗普需要避免轻率地刺激中国。**针对特朗普日前“指责”中国南海和汇率政策，新华社于昨日发表评论指出，特朗普需要抵制一些鹰派政治精英对中国具有刺激和诽谤性质的轻率论调，并强调中美关系需要经受住阻力，需维护共同利益。

(2) **11月债券托管大增 8581 亿。**中央结算公司昨日公布数据显示，11 月末债券托管余额为 43.37 万亿元，当月增加 8581 亿元，较 10 月 4014 亿元环比增逾一倍；其中商业银行 11 月增量大增至 6457 亿元，创 6 月以来单月新高；而此前连续增持的保险机构，则在当月减少 1362 亿元。

(3) **16 博源 SCP001 已构成实质性违约。**上海清算所昨日发布公告称，2016 年 12 月 5 日是内蒙古博源控股集团有限公司

公司 2016 年度第一期超短期融资券（16 博源 SCP001）的付息兑付日。截至日终，上清所仍未足额收到内蒙古博源控股集团有限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。

(4) **保监会要求前海人寿停止开展万能险新业务。**保监会近日下发监管函，针对万能险业务经营存在问题，并且整改不到位的前海人寿采取停止开展万能险新业务的监管措施；同时，针对前海人寿产品开发管理中存在的问题，责令公司进行整改，并在三个月内禁止申报新的产品。对其他在万能险经营中存在类似问题的公司，保监会正密切关注其整改进展，视情况采取进一步的监管举措。

2. 市场动态

(1) 周一央行公开市场进行 700 亿 7

天期、200 亿 14 天期、以及 100 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 1600 亿，今日有 1800 亿逆回购到期；昨日资金流动性较上周有较大幅度改善；一早传统融出机构均有融出，期限主要是不跨年为主，众机构的日常需求较好得到满足，流动性表现均衡；而在 1 个月的跨年期限上，机构融出比较谨慎，出现供不应求的状态；至于更长期限的跨春节资金，买盘兴趣较跨元旦期限减弱。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.2617%、2.5537%、2.9322%，交易量较上一交易日增加 6.59%。

(2) 昨日债市交投平淡，尾盘较为活跃，各个期限收益震荡上行。10 年国开活跃券 160210 最新报价在 3.41%/3.38%，上个交易日尾盘报价在 3.375%/3.365%。10 年期国债期货主力合约 T1703 收报 97.980 元，跌 0.25%；5 年期国债期货主力合约 TF1703 收盘报 99.615 元，跌 0.12%。

(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，北京时间 23:30 收报 6.8830 元，较上一个交易日夜盘收盘价上涨 70 点，在岸人

民币兑美元全天成交量小幅缩减至 302.27 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 内蒙古债 28 (计划发行规模 15.13 亿) 等地方政府债 6 只；16 交行 CD009 (计划发行规模 25 亿，票面利率 3.54%) 等同业存单 111 只；16 国开 13 (增 13) (计划发行规模 80 亿) 等金融债 6 只；16 鹤山国资债 02 (计划发行规模 9 亿) 等企业债 1 只；16 粤发电 MTN001 (计划发行规模 15 亿) 等中期票据 2 只；16 华侨城 SCP006 (计划发行规模 40 亿) 等短期融资券 10 只；共计 136 只债券发行，计划发行额 1352.40 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。