

市场概述

Market Overview

【晨报 20161221】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/12/21

1. 财经新闻

(1) **财政部缩减今日发债规模。**根据中国债券信息网显示，财政部将于今日发行 3 年期和 7 年期国债，发行规模均为 160 亿元人民币。而此前宣布的发行规模均为 280 亿元人民币，较此前确定的规模缩减 120 亿元。

(2) **国海证券认可债券交易协议。**国海证券今早公告称，12 月 20 日与伪造公司印章私签债券交易协议事件相关涉事机构召开协调会议。虽然主要责任在于涉嫌刑事犯罪的个人，但为了维护大局、履行社会责任，公司认可与与会各方的债券交易协议，愿意与与会各方共同承担责任，同时公司将依法追究相关个人伪造公司印章的刑事责任。

(3) **央行近日起对债券代持进行调查。**路透昨日报道称，中国央行部分地方分支机构近日对辖区银行开展债券代

持业务发生情况调查，内容包括是否有代持经历及金额，还包括代持的时间、周期以及原因等。

(4) **协议回购因技术原因导致交易失败并非恶意违约。**浙商证券官网今早发布声明称：公司 19 日部分协议回购因技术原因导致交易失败，涉及金额 3.69 亿，上述交易公司已与相关交易对手协商一致并达成处理方案，并无恶意违约。

(5) **希望通过英国退欧的过渡性协议。**英国首相 May 今早宣布，她希望通过一项过渡协议，帮助英国在 2019 年之后顺利退出欧盟，给予企业一定的时间来适应新的贸易和监管制度。May 表示，英国必须与欧盟建立一个新的关系，而不是仅仅保留目前的部分关系。她说：“我们不是要复制现在成员国关系的一部分，而是确立我们的新关系是什么。”她预计，英国将在 2019 年 4 月完成退欧。

2. 市场动态

(1) 周二央行公开市场操作进行 1550 亿 7 天期, 650 亿元 14 天期, 300 亿 28 天期逆回购操作, 逆回购到期 850 亿, 今日有 1200 亿逆回购到期。昨日早盘资金面依然偏紧, 延续前几个交易日的开盘资金紧张态势, 大行融出很少, 部分非银和农商高价融出隔夜、7 天、以及跨年, 许多机构资金需求需求到中午依然无法得到满足, 虽然资金面开盘依旧紧张但是资金情况明显好于前几个交易日, 下午三点左右资金面彻底宽松下来。但是市场上跨年资金依然紧缺, 融出利率偏高, 各机构跨年资金压力还是不小。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.5111%、3.6443%、4.1417%, 交易量较上一交易日增加 4.82%。

(2) 周二债市交投较活跃, 各个期限收益率上午小幅上行, 下午回落。10 年国开活跃券 160210 最新报价在 3.915%/—%, 上个交易日尾盘报价在 3.89%/3.82%。10 年期国债期货主力合约 T1703 报收 94.750, 涨 0.17%; 5 年期国债期货主力合约 TF1703 报收 97.775, 涨 0.05%。

(3) 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维持震荡,

北京时间 23:30 收报 6.9490 元, 较上一个交易日夜盘收盘价微涨 23 点, 在岸人民币兑美元全天成交量放大至 419.40 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 附息国债 25 (续发)(计划发行规模 160 亿)等国债 2 只; 16 浦发 CD493 (计划发行规模 15 亿)等同业存单 83 只; 16 农发绿色 22 (计划发行规模 60 亿)等金融债 1 只; 16 长春城投 MTN001 (计划发行规模 15 亿)等中期票据 2 只; 16 沪华信 SCP007 (计划发行规模 20 亿)等短期融资券 5 只; 16 平安租赁 ABN001 (A 级计划发行规模 12.23 亿, B 级计划发行规模 0.99 亿, 次级计划发行规模 0.79 亿)等资产支持证券 1 只; 共计 99 只债券发行, 计划发行额 1078.96 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。