

市场概述

Market Overview

【晨报 20161223】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/12/23

1. 财经新闻

(1) 招财宝平台私募债违约事件出现重大转折。券商中国昨晚报道称，浙商财险近期拿着一份抬头为“广发银行惠州分行”开具的保函，到广发银行实施反担保赔偿请求，该保函被验证为假，立即报案。目前侨兴事件已由一个债务违约，上升到一起骗保骗贷的案件。

(2) 美国经济数据好坏不一。美国商务部昨晚公布数据显示，11月美国个人消费者收入和支出增速均不及预期，透露了四季度经济增长可能放缓的信号。其中美联储看重的通胀指标——核心个人消费支出（PCE）物价指数增速也略低于预期。不过美国三季度 GDP 终值好于预期，创 2014 年三季度来最快增速。

(3) 15 机床 CP004 兑付存在不确定性。12 月 22 日晚，大连机床集团有限责任公司公告称，公司 2015 年度第四期短

期融资券（15 机床 CP004）应于 2016 年 12 月 29 日兑付，由于目前公司资金链紧张，“15 机床 CP004”到期兑付存在不确定性。

2. 市场动态

(1) 周四央行公开市场操作进行 1000 亿 7 天期，700 亿元 14 天期，500 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 1600 亿，今日有 1500 亿逆回购到期。昨日资金面整体为宽松状态，早盘即有大量加权隔夜融出，各类机构均有融出，大多机构基本可以在九点左右平头寸；上午后期，就有减点隔夜融出，持续到下午；7 天融出量较前段时间已有较大改善，融出数量与价格均有大幅好转；午盘之前，跨年仍为非银机构在出，午盘过后，有大行融出 14 天跨年资金。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.2424%、2.7883%、4.2036%，交易量较上一交易

日减少 1829.67 亿元。

(2) 周四债市交投较为活跃，各个期限收益率下行。10 年国开活跃券 160210 最新报价在 3.71%/3.70%，上个交易日尾盘报价在 3.75%/—%。10 年期国债期货主力合约 T1703 报收 96.980，涨 0.83%；5 年期国债期货主力合约 TF1703 报收 99.150，涨 0.40%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周四在岸人民币兑美元夜盘时段维持震荡，北京时间 23:30 收报 6.9440 元，较上一个交易日夜盘收盘价微跌 21 点，在岸人民币兑美元全天成交量扩大至 354.70 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 贴现国债 57（计划发行规模 60 亿）等国债 1 只；16 浦发 CD501（计划发行规模 300 亿）等同

业存单 76 只；16 汉口银行二级（计划发行规模 20 亿）等金融债 3 只；16 淮南矿 MTN001（计划发行规模 15 亿）等中期票据 1 只；16 中船 SCP014（计划发行规模 30 亿）等短期融资券 1 只；16 工元 4（A1 级计划发行规模 15 亿，A2 级计划发行规模 41 亿，A3 级计划发行规模 40.65 亿，C 级计划发行规模 5.90 亿）等资产支持证券 1 只；共计 86 只债券发行，计划发行额 1573.15 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。