

市场概述

Market Overview

【晨报 20161220】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/12/20

1. 财经新闻

(1) 明年一季度表外理财将正式纳入广义信贷范围。央行主管的金融时报昨日报道称，央行有关负责人表示，表外理财纳入宏观审慎评估广义信贷指标实施条件已经具备，将于 2017 年一季度评估时开始正式纳入，具体为表外理财资产扣除现金和存款等之后纳入广义信贷范围，纳入后广义信贷指标仍主要以余额同比增速考核。

(2) 美国就业市场为近十年最强。美联储主席耶伦昨日讲话称，美国就业市场乃最近十年最强劲的状态，诸多迹象表明，美国薪资增速回暖，经济增长最终提高大多数美国人的生活水平，就业增加继续维持稳定步伐，失业率下降，但生产力增速令人失望，美国仍然面临挑战，经济增速比之前的复苏时期更加缓慢。

(3) 中城建再度违约。中债登昨日公告称，中国城市建设控股集团有限公司 2012 年度第二期中期票据（12 中城建 MTN2）应于 12 月 17 日付息（遇节假日顺延至 12 月 19 日）。截止营业日终，未收到发行人的应付付息资金，无法代理发行人向持有人付息。

(4) 广西证监局 15 日已入驻国海证券现场检查债券等业务。国海证券今早发布公告称，广西证监局决定对公司债券等相关业务进行现场检查。检查组已于 2016 年 12 月 15 日进场开展工作。

2. 市场动态

(1) 周一央行公开市场操作进行 950 亿 7 天期、300 亿 14 天期以及 550 亿 28 天期逆回购操作，逆回购到期 1150 亿，今日有 850 亿逆回购到期，此外有 600 亿国库现金定存到期。昨日早盘资金面紧张，大型机构融出较少，紧张状态持

续至午盘，跨年与跨春节资金需求依旧较大；下午市场情绪有所好转，资金价格有所下降，但依旧维持偏紧态势；临近尾盘，隔夜资金供给增加，但其他期限依旧紧张。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.3497%、2.9485%、3.9475%，交易量较上一交易日增加 2.08%。

(2) 周一债市交投活跃，各个期限收益率较上周五上行。10 年国开活跃券 160210 最新报价在 3.89%/3.82%，上个交易日尾盘报价在 3.885%/3.79%。10 年期国债期货主力合约 T1703 报收 94.670 元，跌 1.15%；5 年期国债期货主力合约 TF1703 报收 97.835 元，跌 0.58%。

(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震荡走弱，北京时间 23:30 收报 6.9513 元，较上一个交易日夜盘收盘价微挫 3 点，在岸人民币兑美元全天成交量放大至 358.42 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 浦发 CD491（计划发行规模 8 亿）等同业存单 67 只；16 国开 05（增 40）（计划发行规模 30 亿）等金融债 5 只；16 西安航天债 01（计划发行规模 9.90 亿）等企业债 2 只；16 铁二十 MTN001（计划发行规模 5 亿）等中期票据 1 只；16 阳煤 SCP011（计划发行规模 10 亿）等短期融资券 5 只；16 工元 2（优先级计划发行规模 2.61 亿，C 级计划发行规模 0.90 亿）等资产支持证券 4 只；共计 89 只债券发行，计划发行额 657.29 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。