

市场概述

Market Overview

【晨报 20161230】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2016/12/30

1. 财经新闻

(1) CFETS 货币篮子下调美元权重。

中国外汇交易中心昨日发文称，自明年 1 月 1 日起，CFETS 货币篮子中美元权重由 0.2640 调整为 0.2240。CFETS 货币篮子新增 11 种 2016 年挂牌人民币对外汇交易币种至 24 种。外汇交易中心指出，本次新增篮子货币权重累计加总 21.09%，基本涵盖中国主要贸易伙伴币种，货币篮子代表性得到提升，且在历史回溯测算后，新老版本 CFETS 人民币汇率指数运行趋势基本吻合。

(2) 2017 年将继续实施积极的财政政策。中国财政部长肖捷昨日讲话称，2017 年要继续实施积极的财政政策，促进实现经济增长预期目标。适度扩大支出规模，确保财政支出强度不减且实际支出规模扩大。研究实施新的减税措施。贯彻推进供给侧结构性改革部署，推动

解决供需结构性失衡，支持中央企业处置“僵尸企业”。深入推进财税体制改革。加强地方政府性债务管理，确保财政可持续。

(3) 进一步提高保险公司准入门槛，规范投资人入股。中国保监会昨日就修订后的《保险公司股权管理办法》向全社会公开征求意见：保险公司单一股东持股比例上限由 51%降低至 1/3；保险公司控股股东 3 年内不得转让所持股权；投资人举牌保险公司，需报保监会批准；加强资本真实性核查，投资人取得保险公司股权的资金应当保证来源合法。

(4) 美国贸易逆差创 2015 年 3 月最大。周四，美国 11 月贸易帐逆差 653 亿美元，为 2015 年 3 月来最大，远超预期的 616 亿美元，10 月为 619 亿美元。特朗普大选成功后，美元飙升了 5%，强势美元令美国贸易帐逆差扩大。该贸易逆

差或拖累美国四季度 GDP。

(5) 15 机床 CP004 未能按期足额兑付本息。上清所昨日发布公告称，大连机床集团有限责任公司 2015 年度第四期短期融资券（15 机床 CP004）应于 2016 年 12 月 29 日兑付本息，截至到期兑付日日终，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) 周四央行公开市场进行 7 天期 700 亿，14 天期 300 亿逆回购操作，逆回购到期 1650 亿，今日有 1500 亿到期。昨日早盘隔夜资金宽松，跨年资金略紧，后有大行融出 7 天资金，跨年需求基本得到满足。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.168%、3.5593%、5.2315%，交易量较上一交易日增加 0.98%。

(2) 周四债市交投较为冷清，各个期限收益较率下行。10 年国开活跃券 160210 最新报价在 3.685%/3.65%，上个交易日尾盘报价在 3.735%/3.720%。10 年期国债期货主力合约 T1703 收报 97.675，涨 1.18%，5 年期国债期货主力

合约 TF1703 收报 99.585，涨 0.66%。

(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小幅震荡，北京时间 23:30 收报 6.9552 元，较上一个交易日夜盘收盘价微涨 8 点，在岸人民币兑美元全天成交量缩减至 285.67 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 贴现国债 58（计划发行规模 60 亿）等国债 1 只；16 招行 CD258（计划发行规模 50 亿）等同业存单 18 只；16 大通农商二级（计划发行规模 1.50 亿）等金融债 1 只；16 甬城投 SCP001（计划发行规模 5 亿）等短期融资券 1 只；共计 21 只债券发行，计划发行额 414.90 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。