

市场概述

Market Overview

【晨报 20170919】

文/Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/09/19

1. 财经新闻

(1) 8月银行代客结售汇逆差创一年最低，市场购汇意愿创新低。周一，外管局数据显示，8月银行结汇 9422 亿元，售汇 9677 亿元，整体结售汇逆差 256 亿元，较 7 月的 1049 亿元大幅缩小。其中，银行代客结汇 8849 亿元，售汇 9125 亿元，结售汇逆差 276 亿元，创一年新低，不过仍为连续第 27 个月逆差。银行代客远期结汇签约 877 亿元，远期售汇签约 671 亿元，远期净结汇 206 亿元。市场主体结汇意愿有所上升，购汇意愿创新低，个人购汇规模也明显低于 2016 年同期水平。

(2) 中国持美债规模连增六个月，创接近一年新高。中国所持美国国债 7 月增加 195 亿美元，连增六个月，至 1.17 万亿美元，创将近一年新高，继续坐稳美国第一大海外债主宝座。7 月，日

本所持美债环比增加 223 亿美元，至 1.11 万亿美元。

(3) 英央行行长传递温和加息信号。周一，英央行行长尼卡在一年一度的 IMF 央行行长系列讲座期间发言称，英国脱欧可能推升国内通胀，重申未来几个月可能加息，但表示加息是“有限的、循序渐进的”。此后英镑对美元跌破 1.35 关口，跌超百点。上周英央行释放近期加息信号，英镑曾创近 15 个月新高。

(4) 欧元区 8 月 CPI 物价指数符合预期。欧元区 8 月 CPI 终值同比升 1.5%，预期 1.5%，前值 1.3%；环比升 0.3%，预期 0.3%，前值降 0.5%。欧元区 8 月核心 CPI 终值同比升 1.2%，预期 1.2%，初值 1.2%。

2. 市场动态

(1) 周一央行公开市场进行 2800 亿 7 天期、200 亿 28 天期逆回购操作，资

金净投放 3000 亿，今日无逆回购到期。受缴准影响，周一隔夜资金持续紧张，直至中午仍有部分机构头寸未平，午后流动性略有宽松；7 天融出主要为非银机构，价格较高，成交较少；长期方面，跨季需求旺盛。

(2) 周一债市交投火热，期货低开低走，全天收益率小幅上行。10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 95.080，跌 0.29%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.495，跌 0.20%。剩余期限 9.94 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.2275%/4.225%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周一在岸人民币 (CNY) 兑美元北京时间 23:30 收报 6.5761 元，较上周五 (9 月 15 日) 夜盘收盘跌 261 点；全天成交量 232.97 亿美元，较上周五扩大 24.59 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 河南债 14 等地方政府债 18 只，计划发行规模 249.22 亿；17 建设银行 CD091 等同业存单 142 只，计划发行规模 1078.80 亿；17 国开 07 (增 9) 等金融债 4 只，计划发行规模 306 亿；17 淮安新城债等企业债 2 只，计划发行规模 20 亿；17 日照港 MTN003 等中期票据 1 只，计划发行规模 10 亿；17 大同煤矿 SCP007 等短期融资券 5 只，计划发行规模 48 亿；17 速利银丰 2 等资产支持证券 1 只，计划发行规模 52.42 亿；共计 174 只债券发行，计划发行规模 1764.44 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-nex.com.cn

更多信息，请登录网站：www.cfets-nex.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。