

市场概述

Market Overview

【晨报 20170418】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2017/04/18

1. 财经新闻

(1) **广东银监局下发“三套利”自查问卷。**广东银监局日前已将“三套利”银行自查表下发到辖内银行，要求对接银行尽量在周二就提交自查问卷，问卷涉及各类监管套利操作，此外，银监局表示最快本周三就可能“进场检查”。

(2) **特朗普上台第二月中国持美债反弹。**美国财政部周一公布，今年 2 月日本仍是美国最大“债主”，中国在上月减持美债后增持 86 亿美元，持债规模创四个月新高。但 2 月比利时所持美债创逾五年新低，此前机构认为中国借道比利时交易美债，这可能意味着 2 月中国实际持仓更少。

(3) **美财长看涨长期美元汇率。**美国财长努钦再度重申对年内通过税改的预期，并否认了特朗普总统想通过上周表态压低美元汇率，引发新一轮货币战

争。他表示，特朗普对短期内美元升值损害美国出口和经济的看法是事实，美元作为全球储备货币仍长期看涨。

(4) **法国大选选情依然胶着。**离法国大选第一轮投票仅剩一周时间，目前支持率领先的四位候选人民调差距在 3% 以内，都有可能杀进双强对决的第二轮投票。六组民调平均值显示，独立的中间派候选人马克龙支持率稍微领先，极右翼候选人勒庞紧随其后。

2. 市场动态

(1) 周一央行未进行逆回购操作，逆回购到期 200 亿，央行提前进行了 4955 亿 MLF 操作，其中 6 个月 1280 亿元，1 年期 3675 亿元，今日有 100 亿逆回购到期，以及 2345 亿 MLF 到期。昨日早盘资金面较为紧张，各期限融出机构较少，上午收盘时资金面逐步好转直至均衡，下午融出较多，尾盘多减点融出。

(2) 周一债市交投火热，收益率明显上行。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 96.065，跌 0.54%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.555，跌 0.31%。剩余期限 9.36 年的国开债活跃券 160213 收益率尾盘报 4.2225%/4.2205%。

(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 6.8835，较上个交易日夜盘收盘价上涨 20 点；全天成交量扩大 19.20 亿美元，至 250.41 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 辽宁债 08 等地方政府债 6 只，计划发行规模 285.90 亿；17 农业银行 CD031 等同业存单 117 只，

计划发行规模 734.50 亿；17 国开 10 (增 2) 等金融债 3 只，计划发行规模 230 亿；17 京投债 01 等企业债 7 只，计划发行规模 101.60 亿；17 中建 MTN001 等中期票据 8 只，计划发行规模 163 亿；17 沪百联 SCP001 等短期融资券 32 只，计划发行规模 311.60 亿；共计 173 只债券发行，计划发行额 1826.60 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。