

市场概述

Market Overview

【晨报 20180504】

文/Vivian Shen



CFETS-NEX 2018/05/04

1. 财经新闻

(1) 中国央行：人民币合格投资者开展境外投资，不得将人民币汇出境外购汇。中国央行发布通知，规定人民币合格投资者开展境外投资，不得将人民币汇出境外购汇，自印发之日 5 月 3 日起施行，央行上海总部将根据本通知制定相应实施细则以及信息报表，加强对人民币合格投资者的事中事后监督管理。央行对人民币合格投资者境外投资实施宏观审慎管理。

(2) 金管局警告：香港利率会随美国上行，要准备好迎接风险和波动。香港金管局总裁陈德霖警告，美国正处于加息周期，在联系汇率下，香港利率也会随美息逐步上升。他承认，美元与港元利差吸引套利活动；提醒公众“谨慎管理风险，为利率和资产的潜在波动做好准备”。

(3) 美国 3 月贸易逆差创 6 个月新低，出口规模创新高。美国 3 月贸易逆差收窄至 490 亿美元，创去年 9 月以来新低，终结六月连增势头。3 月美国商品与服务出口规模增长 2% 至 2085 亿美元，创历史新高。3 月对华贸易逆差收窄 11.6% 至 259 亿美元。

(4) 美国 4 月 ISM 非制造业指数四个月来最低，就业指数创一年新低。4 月 ISM 非制造业指数为 56.8，连续 99 个月处于荣枯线 50 上方，但连降三个月，低于预期。分项指数中，4 月就业指数创 2017 年 4 月以来新低，4 月 ISM 制造业指数中的就业指数同样下滑。

2. 市场动态

(1) 周四央行公开市场进行 500 亿元 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1200 亿，资金净回笼 700 亿元。今日逆回购到期 600 亿元（7 天 400 亿、63 天 200

亿)。周四资金面延续周三尾盘宽松态势，早盘有大量隔夜和 7 天融出，需求很快得到满足，成交价格均较周三有大幅下降，1 个月跨月和 2 个月跨季资金需求较周三增加。

无

(2) 周四债市交投较冷清，收益率较前一交易日下行。10 年期国债期货主力合约 T1806 收报 94.590，较上个交易日上涨 0.19%；5 年期国债期货主力合约 TF1806 收报 97.830，较上个交易日上涨 0.28%。剩余期限 9.78 年的国开债活跃券 180205 收益率报 4.45%/4.445%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周四在岸人民币兑美元 (CNY) 北京时间 23:30 收报 6.3542 元，较周三夜盘收盘涨 88 点；全天成交量 219.57 亿美元，较周三缩水 15.63 亿美元。

以上仅供参考，谢谢！

3. 一级市场

今日银行间市场有 18 贴现国债 20 等国债 1 只，计划发行规模 100 亿；18 廊坊银行 CD010 等同业存单 165 只，计划发行规模 1008.20 亿；18 北部湾港 MTN001 等中期票据 8 只，计划发行规模 45 亿；18 晋煤 CP001 等短期融资券 2 只，计划发行规模 20 亿；18 华润租赁 ABN001 等资产支持证券 1 只，计划发行规模 13.47 亿；共计 180 只债券发行，计划发行规模 1186.67 亿。

4. 评级变动

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。