

市场概述

Market Overview

【晨报 20180104】

文/Vivian Shen



CFETS-NEX 2017/01/04

1. 财经新闻

(1) 路透：中国央行将自 1 月 22 日起延长大额支付系统运行时间。消息人士透露，中国央行日前下发通知延长大额支付系统运行时间，1 月 22 日起大额支付系统实行 5x21 小时运行。开始受理业务时间由法定工作日（T 日）8:30 调整为前一日（T-1 日）23:30，业务截止时间（清算窗口开启时间）由 17:00 调整为 17:15，清算窗口时间调整为 17:15 至 20:30。

(2) 券商中国：央行同存备案新规出台，银行发行额度缩水成定局。日前市场流传的央行已重新设定 2018 年同业存单年度备案额度测算公式一事属实，今年各家银行同业存单备案额度将限定在去年 9 月末总负债的 1/3，再扣除同业负债后的所得值。近日有银行公布的今年拟发行同业存单额度甚至比去年剧减

逾 70%。

(3) 美联储 12 月会议纪要：加息可能因为税改来得更快。本周二公布的 2017 年 12 月 FOMC 会议纪要显示，美联储官员认为，若通胀因减税而加速回升，可能要加快加息，若通胀仍不能回升到目标，可能要放慢加息。大部分官员支持循序渐进加息。后美元涨幅扩大，现货黄金跌幅扩大，2 年期美债收益率创九年新高。

(4) 美国 12 月 ISM 制造业指数年内次高。美国 12 月 ISM 制造业指数 59.7，连续 16 个月高于荣枯线，代表美国制造业持续扩张，主要受到新订单和生产向好的推动，2017 全年均值 57.6，为 13 年最佳。11 月营建支出环比上涨 0.8%，总额 1.257 亿美元，创历史新高。

2. 市场动态

(1) 周三央行暂停公开市场操作，

逆回购到期 900 亿元，资金净回笼 900 亿元。今日有 1300 亿元逆回购到期（14 天 300 亿、28 天 1000 亿）。周三资金面依旧宽松，早盘人行融出隔夜资金，股份制融出隔夜至 7 天资金，长周期方面，农商和非银融出跨春节资金，主要回购利率多数大幅下行。

（2）周三债市交投平稳，期货全天震荡，收益率全天上行，尾盘稍有回落。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.635，较上个交易日下跌 0.18%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.290，较上个交易日下跌 0.10%。剩余期限 9.64 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.885%/4.8825%

（3）据中国外汇交易中心数据，周三在岸人民币兑美元（CNY）北京时间 23:30 收报 6.5005 元，较周二夜盘收盘跌 56 点；全天成交量 210.58 亿美元，较周二扩大 38.74 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 18 建设银行 CD003 等同业存单 50 只，计划发行规模 436.80 亿；17 国开 12（增 7）等金融债 4 只，计划发行规模 320 亿；18 常城建 MTN001 等中期票据 1 只，计划发行规模 10 亿；18 桑德 SCP001 等短期融资券 6 只，计划发行规模 48 亿；共计 61 只债券发行，计划发行规模 814.80 亿。

4. 评级变动

无

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。