



【晨报 20180123】

文/Vivian Shen

CFETS-NEX 2017/01/23

1. 财经新闻

(1) 中国央行：对商业银行人民币跨境账户融资业务进行逆周期调节。据中国央行微博消息，人民银行对商业银行人民币跨境账户融资业务进行逆周期调节，即人民币跨境账户融资上限由商业银行人民币存款余额和逆周期系数决定。目前逆周期系数为 3%。同日，外汇市场自律机制秘书处表示，人民币对美元中间价报价模型中的“逆周期因子”已恢复中性。

(2) 中国央行营管部发文禁止辖内支付机构为虚拟货币交易提供服务。央行营管部发文禁止辖内支付机构为虚拟货币交易提供服务，并采取有效措施防止支付通道用于虚拟货币交易。各单位应于 1 月 20 日将自查情况、已采取措施等上报营业管理部。

(3) 美国政府面临“关门”危机。

北京时间周六午后，美国参议院否决了为期一个月的临时支出法案，该法案旨在午夜资金失效后维持政府运转。参议院的投票结果是 50-49，未能达到需要通过 60 张支持票。

2. 市场动态

(1) 上周五央行公开市场进行 1300 亿元 7 天期、900 亿元 14 天期、100 亿元 63 天期逆回购操作，逆回购到期 1500 亿元，资金净投放 800 亿元。今日有 900 亿元逆回购到期（7 天 800 亿、63 天 100 亿）。上周五早盘资金面延续紧张势态，大行及股份行隔夜资金融出有限，随着缴税影响逐渐减弱，融出机构增加，下午资金面转松。总体来看，短期各期限成交价格较前一交易日多数下跌；长期资金成交价格多数上涨，成交量较前一交易日减少。

(2) 上周五债市交投活跃，收益率

先降后升。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 91.505，较前一交易日下跌 0.03%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 95.635，较前一交易日下跌 0.06%。剩余期限 9.60 年的国开债活跃券 170215 收益率报 5.125%/5.1175%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，上周五在岸人民币兑美元 (CNY) 北京时间 23:30 收报 6.4030 元，较前一交易日夜盘收盘涨 150 点；全天成交量 135.96 亿美元，较前一交易日扩大 1.12 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 18 交通银行 CD026 等同业存单 119 只，计划发行规模 892.10 亿；18 农发 02 等金融债 2 只，计划发行规模 120 亿；18 晋焦煤 MTN001 等中期票据 3 只，计划发行规模 25 亿；18 西南水泥 SCP001 等短期融资券 15 只，计划发行规模 106.50 亿；18 平安租赁 ABN001 等资产支持证券 1 只，计划发行规模 18.97 亿；共计 143 只债券发行，计划发行规模 1162.57 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。