

市场概述

Market Overview

【晨报 20170221】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2017/02/21

1. 财经新闻

(1) 人民币中间价定价机制昨日起微调。路透昨日报道称，人民币中间价定价机制当日起微调，缩减一篮子货币汇率的计算时段，从原来的 24 小时改为 15 小时，即从下午 4:30 开始计算到早上 7:30。调整的目的是更好反映市场变化，并防止日内投机“中间价模型和收盘价价差”行为。

(2) 财政部 1 月问责地方政府违规举债、担保行为。经济观察网昨日报道称，2017 年 1 月初，财政部曾分别致函内蒙古自治区、河南、重庆、四川等几个地方政府及商务部、银监会 2 个部委，以依法问责部分县市违法违规举债、担保的行为，并依法处理个别企业和金融机构违法违规行为，“要求严肃问责，并按照《中华人民共和国预算法》的有关规定，对负有直接责任的主管人员和其

他直接责任人员予以处理”，并将结果于 2 月 3 日前反馈给财政部。”

(3) 法国大选民调显示勒庞支持率有所上升。据 Opinionway 最新民调，预计法国总统大选中，勒庞、马克龙、菲永首轮支持率分别为 27%、20%、20%（前次分别为 26%、20%、20%）。法国极右翼政党、反欧元政党国民阵线总统候选人勒庞支持率的上升，令投资者对他当选的风险加剧，法国十年期国债收益率上升 10 个基点，法德十年期国债息差扩至 85 个基点，为五年最高。

2. 市场动态

(1) 周一央行公开市场进行 7 天 700 亿、14 天 600 亿、28 天 400 亿逆回购操作，逆回购到期 700 亿，今日有 400 亿逆回购到期。昨日资金面全天偏紧，隔夜至 14 天期限买盘堆积，仅有零星的高价卖盘，传统融出机构均未有短期限融

出，1 个月卖盘众多，买盘需求相对较少。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.6134%、3.3453%、4.0139%。

(2) 周一债市早盘交投火热，期货高开，午后期货攀升，收益率全天下降。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 97.305，涨 0.64%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.785，涨 0.29%。10 年期国开债活跃券 160213 收益率上周五尾盘报 4.06%/4.055%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周一在岸人民币兑美元夜盘时段小幅波动，北京时间 23:30 收报 6.8750 元，较上一个交易日夜盘收盘价下挫 61 点，在岸人民币兑美元全天成交量放大至 186.47 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 中信银行 CD044（计划发行规模 105.50 亿）等同业存单 128 只；16 国开 13（增 22）（计划发行

规模 100 亿）等金融债 3 只；17 津旅游 MTN001（计划发行规模 3 亿）等中期票据 2 只；17 陕有色 SCP001（计划发行规模 10 亿）等短期融资券 9 只；17 包银 1（A 级计划发行规模 14.68 亿，B 级计划发行规模 1.80 亿，C 级计划发行规模 4.91 亿）等资产支持证券 3 只；共计 153 只债券发行，计划发行额 2020.76 亿。

4. 评级变动

下调“09 宜化债”债项评级由 AA+至 AA（中诚信）；

下调湖北宜化化工股份有限公司主体评级由 AA+至 AA（中诚信）；

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。