

市场概述

Market Overview

【晨报 20171115】

文/Vivian Shen



CFETS-NEX 2017/11/15

1. 财经新闻

(1) 10 月外汇占款连续两个月增加。央行发布数据显示，10 月末外汇占款 21.51 万亿元人民币，外汇占款余额较上月增加 20.98 亿元人民币，为连续俩个月增加。四大行 10 月末人民币贷款总额为 42.7 万亿元，四大行 10 月新增人民币贷款 2106 亿元人民币。

(2) 国开行制定人民币金融债券置换招标业务试行阶段操作指引。国开行公告称，为进一步提高开发银行人民币金融债券市场流动性，促进国开债可持续发展，增强市场活力，制定人民币金融债券置换招标业务试行阶段操作指引。

(3) 国际评级机构认定委内瑞拉已现债务违约。由于委内瑞拉未能及时在 30 天宽限期内支付一笔 2 亿美元的利息，标普周二正式宣布委内瑞拉出现债务违约。这笔利息本应该于 10 月中旬支付给

委内瑞拉 2019 年和 2024 年到期债券的持有者。标普下调委内瑞拉长期外汇主权信用评级从 CC 至 SD，并对委内瑞拉债信观察持负面观点，认为其在未来三个月内再出现违约的概率为 50%。

(4) 美国 10 月 PPI 同比增速创 6 年新高。美国劳工部公布数据显示，美国 10 月 PPI 环比上升 0.4%，高于预期 0.1%，前值为上升 0.4%。美国 10 月核心 PPI 环比上升 0.4%，高于预期 0.2%，前值为上升 0.4%。美国 10 月 PPI 同比与核心 PPI 同比均创 2012 年 2 月以来新高。

2. 市场动态

(1) 周二央行公开市场进行了 1300 亿元 7 天逆回购操作、1200 亿元 14 天逆回购操作、300 亿元 63 天期逆回购操作，逆回购到期 1400 亿，资金净投放 1400 亿元。今日有 1100 亿逆回购到期（7 天 700 亿、14 天 400 亿）。周二资金面早盘

呈现较为紧张态势，仅有少数大行、股份行隔夜和 7 天融出，7 天主要为非银机构融出。有部分农商行、城商行融出 14 天到 1 个月跨月资金；午后隔夜资金融出量增多，总体市场继续处于均衡状态。除 1 年期外，其余期限资金价格较周一上涨。

(2) 周二债市交投火热，期货先低开低走，下午拉升，收益率较周一显著上升。10 年期国债期货主力合约 T1712 盘中一度下行 0.46%，最终收报 92.330，上涨 0.15%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 95.890，上涨 0.20%。剩余期限 9.79 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.72%/4.71%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周二在岸人民币 (CNY) 兑美元北京时间 23:30 收报 6.6366 元，较周一夜盘收盘涨 32 点；全天成交量 277.65 亿美元，大致持稳于周一 274.39 亿美元的水平附近。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 附息国债 20 (续 2) 等国债 1 只，计划发行规模 320 亿；17 黑龙江债 21 等地方政府债 10 只，计划发行规模 131.42 亿；17 交通银行 CD072 等同业存单 153 只，计划发行规模 1182.10 亿；17 农发 15 (增 9) 等金融债 7 只，计划发行规模 175 亿；17 六枝债 01 等企业债 3 只，计划发行规模 25 亿；17 悦达 MTN004 等中期票据 9 只，计划发行规模 83 亿；17 格力 SCP005 等短期融资券 14 只，计划发行规模 141.50 亿；17 铁道 17 等政府支持债券 2 只，计划发行规模 200 亿；共计 199 只债券发行，计划发行规模 2258.02 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。