

市场概述

Market Overview

【晨报 20170213】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2017/02/13

1. 财经新闻

(1) 刘士余表示将进一步丰富国债期货市场的投资者结构。在全国证券期货监管工作会议上，证监会主席刘士余提出，积极稳妥推进期货及衍生品市场发展，择机退出股指期货临时性限制措施。此外他还表示，继续深入论证和积极准备原油期货上市，积极发展国债期货市场，会同国务院有关部门研究进一步丰富国债期货市场的投资者结构，促进国债收益率曲线的优化。

(2) 部分银行资金在金融体系内部“虚投空转”。人民日报今早刊文称，杠杆收购、债市违约、票据风波……一段时间以来，不少热点金融事件背后都有银行资金的影子。相比传统的信贷资金，这些钱通过在不同金融市场、不同机构之间穿梭，在金融体系内部“虚投空转”，一些风险已经显现。这种新的金融风险

隐患，引起市场高度关注。

(3) CFETS 人民币汇率指数按周持平。上周五 CFETS 人民币汇率指数录得 94.03，与上周持平；参考 BIS、SDR 货币篮子的人民币汇率指数分别为 95.29、95.50，按周分别上涨 0.03 和 0.07。

2. 市场动态

(1) 上周五央行依旧暂停逆回购操作，逆回购到期 800 亿，本周有逾万亿逆回购及 MLF 到期，其中今日到期 1900 亿。上周五资金面总体近宽松，早盘各家机构纷纷融出隔夜及 7 天资金，大行非银均有融出，部分大机构融出 14 天资金，7 天及 14 天资金需求相对较大；1 个月的融出价格相对较高，1 个月以上融出和需求相对较少。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.2568%、2.6096%、3.1137%。

(2) 上周五债市交投火爆，各个期

限收益率震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T1706 收报 94.355，跌 0.21%，5 年期国债期货主力合约 TF1706 收报 98.020，跌 0.10%。10 年期国开债活跃券 160213 收益率上周五尾盘报 4.15%/4.1425%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，上周五在岸人民币兑美元夜盘时段维持震荡，北京时间 23:30 收报 6.8775 元，较上一个交易日夜盘收盘价下挫 100 点，在岸人民币兑美元全天成交量缩减至 191.62 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 农业银行 CD002

(计划发行规模 1.10 亿) 等同业存单 114 只；17 泸州农商二级 (计划发行规模 10 亿) 等金融债 1 只；17 物产中大 SCP002 (计划发行规模 10 亿) 等短期融资券 6 只；共计 121 只债券发行，计划发行额 1261.90 亿。

4. 评级变动

无

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。