

市场概述

Market Overview

【晨报 20170816】

文/ Ryan Rui



CFETS-NEX 2017/08/16

1. 财经新闻

(1) 央行发布 7 月份金融市场运行情况。7 月份，债券市场共发行各类债券 3.9 万亿元。货币市场成交共计 59.5 万亿元，同比下降 14.3%，环比下降 6.7%。银行间债券市场现券成交 9.2 万亿元，日均成交 4364.2 亿元，同比下降 20.5%，环比增长 4.6%。7 月份，沪市日均交易量为 2162 亿元，环比增长 28.5%；深市日均交易量为 2497 亿元，环比增长 14.3%。

(2) 发改委：开展 2016 年度企业债券信用评级机构信用评价工作。本次信用评价期限为 2016 年 1 月 1 日至 12 月 31 日，评价对象为中诚信国际信用评级有限责任公司、联合资信评估有限公司、大公国际资信评估有限公司、鹏元资信评估有限公司等 6 家评级机构。信用评价指标体系包括实绩评价和综合评价两

大部分，实绩评价主要以案例评价为依据，综合评价包括社会信用评价、主管部门评价、发行人评价、技术评估和登记托管机构评价、市场机构评价、专家评价等六方面评价指标。

(3) 中国重新成为美国国债最大的海外持有国。美国财政部本周二公布的国际资本流动报告（TIC）显示，2017 年 6 月，中国所持美国国债规模环比增加 443 亿美元，增至 1.1465 万亿美元。至此，中国连续五个月增持美国国债，6 月持仓规模创九个月新高。报告还显示，6 月美国流入的国际资本剧减。6 月美国国际资本净流入 77 亿美元，环比减少 86%，5 月净流入规模下修 26 亿美元至 547 亿美元。6 月美国长期资本净流入 344 亿美元，较 5 月净流入规模下降 63%。

(4) 美国零售销售创 2016 年 12 月以来最大增幅。美国昨晚公布 7 月零售

销售数据显示，7 月零售销售环比增长 0.6%，好于预期的 0.3%，环比数据已经连续 5 个月为非负，此外，7 月零售销售同比增长 4.2%。美国 7 月零售销售创全年最大涨幅，表明美国三季度消费开支开局强劲。无论是消费者在 7 月的表现、先前数据的上修均表明，强劲岗位需求、通胀持稳、低借贷成本都为购买力的提升做出了贡献。

2. 市场动态

(1) 周二央行进行 3995 亿一年期 MLF 操作，但未进行公开市场逆回购操作，逆回购和 MLF 分别到期 1400 亿、2875 亿，资金净回笼（包括 MLF 到期）280 亿，今日有 1000 亿逆回购到期。周二早盘资金延续紧张态势，大行和城商、非银短期限融出都较少；临近午盘，大行融出少量隔夜和 7 天，很多大行和城商需求仍然没有得到满足；午盘回来，大行、城商、农商和非银机构都处于需求得不到满足的状态；临近尾盘，依然没有隔夜融出，资金呈现非常紧的态势。

(2) 周二债市交投非常热烈，早盘做多情绪强烈，收益率下行很快，下午资金层面依旧较紧，尾盘收益率上行显著。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 95.070，涨 0.09%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.395，涨 0.01%，剩余期限 9.66 年的国开债活跃券 170210

收益率尾盘报 4.2675%/4.26%。

(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 6.6860 元，较前一交易日夜盘收盘价跌 145 点；全天成交量 314.70 亿美元，较前一交易日夜盘缩减 23.75 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 附息国债 13（续 2）等国债 1 只，计划发行规模 360 亿；17 建设银行 CD062 等同业存单 133 只，计划发行规模 1048.70 亿；17 农发 10（增 3）等金融债 4 只，计划发行规模 115 亿；17 许昌专项债等企业债 4 只，计划发行规模 45.20 亿；17 东华能源 MTN001 等中期票据 17 只，计划发行规模 169 亿；17 正泰 SCP001 等短期融资券 19 只，计划发行规模 142.10 亿；共计 178 只债券发行，计划发行规模 1880 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-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。