

市场概述

Market Overview

【晨报 20170104】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2017/01/04

1. 财经新闻

(1) **禁止险企承保有投机风险的保险产品。**为规范财产保险公司产品开发，保监会昨日印发通知，禁止保险公司承保既有损失可能又有获利机会的投机风险的保险产品。2016 年以来，监管层对保险资金的监管越发严格，严控保险行业“野蛮生长”的基调越发清晰。

(2) **美国 12 月 ISM 制造业超预期。**周二，美国供应管理协会（ISM）公布数据显示，美国 12 月 ISM 制造业指数 54.7，预期 53.7，11 月前值为 53.2。最新数据表明美国制造业继续扩张。与 ISM 同时公布的 11 月营建支出环比增 0.9%，创十年最高。两大数据推动美元涨势扩大。

(3) **特朗普正式任命钢铁“强硬派”出任贸易代表。**据 CNBC 报道，特朗普周二正式任命 Robert Lighthizer 为美国贸易代表，特朗普过渡团队声明称，

Robert Lighthizer 曾在里根任总统时担任美国贸易代表（USTR）副代理，在贸易政策的制定和谈判达成二十多个双边贸易协定中，从钢铁到粮食，起到了举足轻重的作用。

2. 市场动态

(1) 周二央行公开市场进行 7 天期 200 亿，14 天期 200 亿逆回购操作，逆回购到期 1950 亿，净回笼 1550 亿，今日有 1600 亿逆回购到期。昨日资金呈现宽松的态势，隔夜至一个月均有大行融出，长期方面，1 个月跨春节资金需求增多。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.1609%、2.7696%、2.6623%，交易量较上个交易日增加约 20%。

(2) 周二债市交投较为平淡，各个期限收益率震荡上行。10 年国开活跃券 160210 最新报价在 3.695%/3.68%，上个交易日尾盘报价在 3.67%/3.65%。10 年

期国债期货主力合约 T1703 收报 97.390，涨 0.06%，5 年期国债期货主力合约 TF1703 收报 99.390，涨 0.04%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周二在岸人民币兑美元夜盘时段小幅走弱，北京时间 23:30 收报 6.9628 元，较上一个交易日夜盘收盘价下跌 161 点，在岸人民币兑美元全天成交量扩大至 339.99 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 16 附息国债 24 (续 2) (计划发行规模 200 亿) 等国债 2 只；17 兴业 CD002 (计划发行规模 4 亿) 等同业存单 19 只；17 农发 05 (计划发

行规模 40 亿) 等金融债 5 只；17 沪世茂 MTN001 (计划发行规模 13 亿) 等中期票据 3 只；17 河钢 SCP001 (计划发行规模 24 亿) 等短期融资券 2 只；共计 31 只债券发行，计划发行额 860.70 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。