

市场概述

Market Overview

【晨报 20171219】

文/ Ryan Rui



CFETS-NEX 2017/12/19

1. 财经新闻

(1) 11 月银行代客结售汇终结此前连续两个月顺差。外管局周一公布的数据显示，中国 11 月银行结售汇逆差 497 亿元人民币，前值为顺差 183 亿元；1-11 月银行累计结售汇 8043 亿元人民币（1-10 月为逆差 7545 亿元）。11 月银行代客结售汇逆差 312 亿元，前值为顺差 501 亿元；1-11 月银行代客结售汇逆差 5207 亿元人民币（1-10 月逆差 4894 亿元人民币）。

(2) 央行发布 11 月份金融市场运行情况报告。金融市场运行情况报告显示，11 月货币市场成交共计 68.7 万亿元，同比增长 16.96%，环比增长 33.88%；银行间债券市场现券成交 10.6 万亿元，日均成交 4831 亿元，同比减少 13.50%，环比增加 0.49%。

(3) 11 月欧元区 CPI 终值持平于预

期。欧元区周一公布数据显示，11 月 CPI 同比终值 1.5%，持平于预期和初值；核心 CPI 同比终值 0.9%，持平于预期和初值。11 月 CPI 环比 0.1%，持平于预期，前值由 0.1%修正为 0.1%。

(4) 12 中城建 MTN2 构成实质违约。10 亿元“12 中城建 MTN2”应于 12 月 17 日兑付，截至兑付日日终，由于中城建资金链紧张，未能按照约定将兑付资金按时足额划至托管机构，已构成实质违约。

2. 市场动态

(1) 周一央行公开市场进行了 1200 亿元 7 天期、1100 亿 14 天期、700 亿元 28 天期逆回购操作，逆回购、MLF 共到期 2270 亿，资金净投放 730 亿元（含 MLF）。今日有 800 亿逆回购到期。周一资金面整体均衡偏紧，早盘各类机构积极融入隔夜、7 天以及跨年期限，之后隔

夜、7 天需求逐渐平盘，隔夜呈现均衡状态；午后市场维持均衡状态，尾盘隔夜略有盈余。

(2) 周一债市交投平淡，期货高开低走，全天收益小幅上行。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 92.860，较上个交易日下跌 0.03%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.415，较上个交易日下跌 0.01%。剩余期限 9.69 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.80%/4.7925%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周一在岸人民币兑美元（CNY）北京时间 23:30 收报 6.6170 元，较上周五（12 月 15 日）夜盘收盘跌 90 点；全天成交量 318.95 亿美元，较上周五扩大 40.49 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 兴业银行 CD664

等同业存单 140 只，计划发行规模 916.60 亿；17 三峡银行二级债 01 等金融债 1 只，计划发行规模 18 亿；17 昆明公租 MTN002 等中期票据 7 只，计划发行规模 48 亿；17 众品 SCP002 等短期融资券 7 只，计划发行规模 117 亿；17 臻金 1 等资产支持证券 1 只，计划发行规模 1.33 亿；共计 157 只债券发行，计划发行规模 1100.93 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。