

市场概述

Market Overview

【晨报 20171017】

文/ Ryan Rui



CFETS-NEX 2017/10/17

1. 财经新闻

(1) 9 月财政支出增速创年内新低。

周一，财政部发布 2017 年 9 月及前三季度财政收支情况，9 月份全国一般公共预算收入 12714 亿元，同比增长 9.2%（8 月增长 7.2%）；1-9 月累计，全国一般公共预算收入 134129 亿元，同比增长 9.7%（1-8 月增长 9.8%）；9 月份全国一般公共预算支出 20246 亿元，同比增长 1.7%，增速续创年内新低（8 月增长 2.9%）；1-9 月累计，全国一般公共预算支出 151873 亿元，同比增长 11.4%（1-8 月增长 13.1%）。

(2) 依法全面从严监管，确保市场行稳致远。央行主管媒体今早发文称，规范市场，监管先行。我国资本市场影响面广、敏感度高，其健康有序发展离不开依法监管、全面监管、从严监管。要把主动防范化解系统性金融风险放在

更加重要的位置，确保资本市场稳健运行，确保各项改革稳步推进，并统筹谋划好资本市场近中远期的发展战略和改革举措。

(3) 泰勒规则创始人、经济学家泰勒得到特朗普青睐。本周一美国媒体援引知情者消息称，下任美联储主席角逐中，泰勒规则创始人、斯坦福经济学家泰勒（John Taylor）给特朗普留下了好印象，特朗普对他大加赞赏，现年 70 岁的泰勒符合白宫官员对美联储主席人选的多项要求，若根据泰勒规则，美联储现在应将利率调升到 5% 以上。消息公布后，美元指数、2 年和 5 年期美债收益率均刷新日高。

2. 市场动态

(1) 周一央行公开市场进行 200 亿元 7 天期逆回购操作，逆回购到期 200 亿，资金零投放零回笼。今日有 600 亿

逆回购到期，此外有 1280 亿 MLF 到期。

周一资金面呈现较为宽松态势。早盘有大量隔夜融出，市场需求迅速饱和，早盘即有减点资金融出；午盘隔夜市场持续维持宽松态势，但减点趋势逐渐减弱，最后基本在加权融出。整体来看，周一资金面处于宽松状态，但已经有收紧趋势。

(2) 周一债市交投火热，期货低开低走，全天收益大幅上升。10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 94.315，跌 0.36%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.020，跌 0.25%。剩余期限 9.86 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.2975%/4.2925%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，周一在岸人民币 (CNY) 兑美元北京时间 23:30 收报 6.5890 元，较上周五 (10 月 13 日) 夜盘收盘跌 85 点；全天成交量 291.05 亿美元，较上周五缩水 80.28 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 甘肃债 21 等地方政府债 15 只，计划发行规模 108 亿；17 农业银行 CD112 等同业存单 151 只，计划发行规模 879.30 亿；17 国开 15 (增 7) 等金融债 4 只，计划发行规模 311 亿；17 黄梅债 02 等企业债 3 只，计划发行规模 13.60 亿；17 共享工业 MTN001 等中期票据 11 只，计划发行规模 106 亿；17 万宝 SCP002 等短期融资券 13 只，计划发行规模 180 亿；17 瑞泽 1 等资产支持证券 1 只，计划发行规模 29.79 亿；共计 200 只债券发行，计划发行规模 1627.69 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。