

市场概述

Market Overview

【晨报 20180206】

文/ Ryan Rui



CFETS-NEX 2018/02/06

1. 财经新闻

(1) 两部委：2018 年严打以创新为名的各类外汇违法犯罪行为。日前，国家外汇管理局与公安部联合召开打击外汇违法犯罪活动工作总结部署会议。坚决打击地下钱庄等外汇违法犯罪活动，刑事追责和行政处罚两手抓，使地下钱庄经营者和参与地下钱庄交易“客户”受到应有的惩处，形成震慑，根除地下钱庄等外汇违法犯罪活动滋生土壤，维护国家经济与金融安全。

(2) 资管新规力争“两会”前发布。一财今早报道称，从接近监管人士处独家获悉，市场期待已久的资产管理业务新规争取在今年全国“两会”前发布。正式稿有不少修改，主要是让新规更严谨更有操作性，但大原则不会放松，例如打破刚兑、实行净值化管理、消除多层嵌套等内容。此前市场争议的“新老

划断”过渡期应该会有适当延长，但核心不是延长多少时间，而是如何将表外业务回归表内，变相的账外经营不能再继续。

(3) 鲍威尔就任美联储主席，称对金融系统保持警惕。周一美联储理事鲍威尔宣誓就任美联储主席。他表示，将致力于有效的金融监管；目前美国金融系统比金融危机初期强健，他和同事将保持警惕，准备回应不断演变的风险。他讲话后，美股延续上周跌势，“恐慌指数”创美国大选以来新高。

(4) 欧元波动或影响通胀回升，QE 未大功告成。欧洲央行行长德拉吉在欧洲议会讲话时称，欧元区经济增长比此前预计的强劲，明显高于潜在水平，同时对通胀向目标水平靠近更有信心，但认为近来汇率波动可能有负面影响，QE 仍需耐性和持久性；欧央行在留意数字

货币的金融风险。他讲话期间，欧元兑美元曾跌破 1.24 刷新日低。

2. 市场动态

(1) 周一央行暂停公开市场操作，逆回购到期 400 亿元，资金净回笼 400 亿元。今日有 800 亿元逆回购到期。周一市场早盘资金面总体宽松，各期限均有融出，跨春节资金需求小幅增加，下午资金融出总体减少。总体来看，各期限成交价格涨跌互现，多数期限成交量较上个交易日增加。

(2) 周一债市交投平淡，期货高开低走，尾盘收益小幅上行，短券需求活跃。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 91.755，较上个交易日下跌 0.27%，5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 95.880，较上个交易日下跌 0.10%。剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 170215 收益率报 5.0725%/5.065%。

(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 6.2940 元，较上个交易日夜

盘收盘涨 50 点；全天成交量 115.23 亿美元，较上个交易日缩水 36.83 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 18 农业银行 CD020 等同业存单 106 只，计划发行规模 1359 亿；17 国开 12（增 12）等金融债 4 只，计划发行规模 260 亿；18 京诚债等企业债 4 只，计划发行规模 28.40 亿；18 沪世贸 MTN001 等中期票据 6 只，计划发行规模 64 亿；18 永达 SCP001 等短期融资券 15 只，计划发行规模 177 亿；18 中成租赁 ABN001 等资产支持证券 1 只，计划发行规模 4.42 亿；共计 138 只债券发行，计划发行规模 1892.82 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。