

市场概述

Market Overview

【晨报 20170109】

文/ Ryan Rui

CFETS ICAP

CFETS-ICAP 2017/01/09

1. 财经新闻

(1) 央行召开 2017 年工作会议，列出 10 项主要任务。2017 年中国人民银行工作会议 1 月 5 日至 6 日在北京召开，会上总结了 2016 年工作并部署了 2017 年任务，任务包括保持货币政策稳健中性、继续做好供给侧结构性改革金融服务工作等，相较于 2016 年的重点工作任务，17 年的工作计划中明确提出了要因城施策，继续落实好差别化住房信贷政策；积极引导和稳定市场预期，保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定；切实防范化解金融风险，牢牢守住不发生系统性风险底线。

(2) 中国 12 月外汇储备维持在三万亿美元上方。周六公布的中国 12 月外汇储备 30105.2 亿，预期 30100 亿，前值 30516 亿。较 11 月环比下降 1.3%，连续第六个月缩水，但单月降幅较上月收窄，

整体规模降至近六年最低。对此，外管局负责人答记者问时表示，从全年的情况看，央行稳定人民币汇率是外汇储备规模下降的最主要原因。从 12 月情况看，央行向市场提供外汇资金以调节外汇供需平衡、非美元货币对美元总体贬值等多重因素综合作用，令外汇储备规模出现下降。

(3) 特朗普的经济政策将给中国带来不确定性。财政部副部长朱光耀昨日表示称，对中国第四季度经济增速达到 6.7%或以上有信心；特朗普的经济政策将给中国带来不确定性；中国必须关注贸易、美联储加息和特朗普政策的影响；特朗普政策短期内将支撑美国经济，长期影响还需观察。

(4) 美国 12 月新增非农人数不及预期。上周五美国劳工部公布数据显示，12 月美国新增非农人数不及预期，失业

率较上月小幅攀升，但美联储高度关注的薪资增速数据较好，同比增幅创 2009 年来最大。数据表明美国劳动力市场在 2016 年底时表现强劲，支持美联储进一步加息。

2. 市场动态

(1) 上周五央行公开市场进行 7 天期 100 亿、28 天期 700 亿逆回购操作，逆回购到期 2400 亿，本周有 4300 亿逆回购到期，其中今日到期 400 亿。上周五早盘资金面延续宽松态势，大行、城商行及其他机构融出隔夜和 7 天资金，隔夜上午即出现减点出的情况，资金供大于求，许多机构短期资金需求中午前已经得到满足，跨春节资金价格较上一交易日有所下降。隔夜、7 天、14 天回购收盘加权利率分别在 2.0823%、2.4205%、2.7248%，交易量较上一交易日增加 6.97%。

(2) 上周五债市交投稍显清淡，各个期限收益率震荡下行。10 年国开活跃券 160210 最新报价在 3.77%/3.76%，上个交易日尾盘报价在 3.785%/3.78%。10 年期国债期货主力合约 T1703 收报 97.240，跌 0.04%，5 年期国债期货主力

合约 TF1703 收报 99.435，涨 0.01%。

(3) 据中国外汇交易中心数据，上周五在岸人民币兑美元夜盘时段维持震荡，北京时间 23:30 收报 6.9330 元，较上一个交易日夜盘收盘价大跌 500 点，在岸人民币兑美元全天成交量小幅扩大至 280.98 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 招商 CD009（计划发行规模 15 亿）等同业存单 58 只；17 桑德 MTN001（计划发行规模 10 亿）等短期中期票据 1 只；17 中建材 SCP001（计划发行规模 30 亿）等短期融资券 3 只；共计 62 只债券发行，计划发行额 383.30 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。