

市场概述

Market Overview

【晨报 20171229】

文/ Ryan Rui



CFETS-NEX 2017/12/29

1. 财经新闻

(1) 截至 11 月末全国地方政府债务余额 16.6 万亿元。财政部今早公布数据显示,截至 11 月末,全国地方政府债务余额 165944 亿元,控制在全国人大批准的限额之内。其中,一般债务 104109 亿元,专项债务 61835 亿元;政府债券 147125 亿元,非政府债券形式存量政府债务 18819 亿元。

(2) 财政部:2018 年加快财税制度改革,重在防控地方政府债务风险。全国财政工作会议近日在京召开,会议指出,支持打好防范化解重大风险攻坚战,重点是有效防控地方政府债务风险,坚决制止违法违规融资担保行为,严禁以政府投资基金、政府和社会资本合作 (PPP)、政府购买服务等名义变相举债。

(3) 三季度我国外债规模平稳增长。外管局昨日公布数据显示,前三季度经

常账户顺差 1098 亿美元,非储备性质的金融账户顺差 1121 亿美元;前三季度储备资产因国际收支交易增加 589 亿美元,其中,外储增加 598 亿美元,在 IMF 的储备头寸等减少 9 亿美元;截至三季度末,全口径外债余额 1.68 万亿美元,二季度末为 1.56 万亿美元。

2. 市场动态

(1) 周四央行暂停公开市场操作,逆回购到期 300 亿元,资金净回笼 300 亿元。今日有 500 亿元逆回购到期。周四银行间市场资金面依旧均衡偏紧,早盘隔夜资金宽松,午盘开始银行减少对非银机构的融出,7 天资金供不应求,利率进一步飙升,最高价甚至高于交易所,其他期限方面,14 天卖盘以非银为主,1 个月资金小量成交。尽管市场传闻财政投放资金陆续到账,但对资金面难有大幅改善。

(2) 周四债市交投较为冷清, 收益率全天小幅震荡。10 年期国债期货主力合约 T1803 收报 93.090, 较上个交易日上涨 0.11%, 5 年期国债期货主力合约 TF1803 收报 96.505, 较上个交易日上涨 0.03%。剩余期限 9.66 年的国开债活跃券 170215 收益率尾盘报 4.8425%/4.84%。

(3) 据中国外汇交易中心数据, 周四在岸人民币兑美元 (CNY) 北京时间 23:30 收报 6.5333 元, 较前一个交易日上涨 237 点, 全天成交量 156.41 亿美元, 较前一交易日减少 0.42 亿美元。

3. 一级市场

今日银行间市场有 17 贴现国债 61 等国债 1 只, 计划发行规模 150 亿; 17 上海银行 CD304 等同业存单 21 只, 计划发行规模 186.60 亿; 17 齐鲁银行债等金融债 2 只, 计划发行规模 40 亿; 17 兰轨道

债 01 等企业债 1 只, 计划发行规模 6 亿; 17 余杭创新 MTN001 等中期票据 2 只, 计划发行规模 12.10 亿; 17 皖北煤电 SCP003 等短期融资券 5 只, 计划发行规模 12 亿; 17 乐融 1 等资产支持证券 2 只, 计划发行规模 5 只; 共计 37 只债券发行, 计划发行规模 421.70 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-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。