

市场概述 晨报

常规报告系列

 **NEX** 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2023-05-16】

财经新闻

- (1) **央行发布一季度货币政策执行报告。** 央行指出，稳健的货币政策要总量适度，节奏平稳；强化金融稳定保障体系，防范境外风险向境内传导。加快推进金融稳定保障体系建设，完善金融稳定立法和金融稳定保障基金制度。
- (2) **“北向互换通”运行首日：达成人民币利率互换交易 162 笔，名义本金总额 82.59 亿元。** 据上证报，内地与香港利率互换市场互联互通合作正式上线运行。上线首日，20 家“北向互换通”报价商与 27 家境外投资者通过交易中心系统达成人民币利率互换交易 162 笔，名义本金总额 82.59 亿元人民币，覆盖境外银行、境外券商、境外资管产品等各个类型境外投资者，交易品种包括 Shibor 和 FR007。
- (3) **美国银行危机时中日两大“债主”增持美债，中国持仓终结七连降。** 3 月中国所持美债增加 205 亿美元，终结了连续七个月创 2010 年来持仓新低的势头；日本持仓在 2

月回落后反弹，未继续靠近三年多低位。不过，海外增持黄金的势头更为迅猛。一季度全球央行黄金购买量创历史同期新高，截至 3 月中国黄金储备连升五个月。

(4) 美国财长耶伦再发警告，重申政府最早 6 月 1 日现金告罄。当地时间 5 月 15 日，美国财政部长珍妮特·耶伦再次警告称，除非美国国会提高或暂停联邦债务限额，否则美国财政部最早可能会在 6 月 1 日前用完现金。美国国会众议院议长凯文·麦卡锡 15 日表示，目前关于避免美国历史性违约的谈判进展甚微。美国总统拜登则在当天宣布了 16 日与国会领袖会面的计划。



市场动态

(1) 周一央行开展 20 亿 7 天期逆回购、1250 亿 MLF 操作，逆回购到期 40 亿，全口径资金净投放 1230 亿。今日逆回购到期 20 亿元、MLF 到期 1000 亿元。周一资金面整体均衡，短期限资金价格小幅上行。

(2) 周一国债期货全线小幅收跌，现券收益率震荡走升。10 年期国债期货主力合约 T2306 收报 101.700，较上个交易日下跌 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2306 收报 101.835，较上个交易日下跌 0.05%。截至目前，剩余期限 9.82 年的国开债活跃券 230205 收益率报 2.8810%/2.8810%。

(3) 据中国外汇交易中心数据显示，上个交易日夜盘在岸人民币兑美元（CNY）收报 6.9520，较前一交易日夜盘收涨 65 个基点。成交量 463.66 亿美元，较前一交易日增加 97.45 亿美元。



一级市场

今日银行间市场有 23 天津 28 等地方政府债共 16 只，计划发行规模 882.53 亿；23 光大银行 CD129 等同业存单共 125 只，计划发行规模 874.90 亿；23 国开 03(增 17)等金融债共 9 只，计划发行规模 765.00 亿；23 中广核 MTN001 等中期票据共 3 只，计划发行规模 50.00 亿；23 华能集 SCP008 等短期融资券共 5 只，计划发行规模 40.00 亿。共计 158 只债券发行，计划发行规模 2612.43 亿。



评级动态

无。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu

如果您对本文有任何评论与见解
请发电邮至: SHOffice@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松查看更多资讯



免责声明:

文中信息均来自公开资料，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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN