



【2020-01-16】

今日央行发公告称，为对冲税期和现金投放高峰，维护春节前银行体系流动性合理充裕，人民银行开展了 3000 亿元 14 天期逆回购操作。今日无逆回购到期，逆回购资金净投 3000 亿。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.6090%，较上个交易日下跌 4.50 个基点；7 天品种报 2.6630%，较上个交易日下跌 5.40 个基点；1 个月品种报 2.8000%，较上个交易日上涨 0.10 个基点；3 个月品种报 2.8680%，较上个交易日上涨 0.30 个基点。今日资金面早盘紧张，隔夜至 7 天期限有股份制大行融出，但需求较多；跨春节期限有价格持续走高。午后隔夜融出增多，机构需求均能得到满足，资金面恢复宽松态势。

央行发布数据显示，中国 2019 年 12 月 M2 同比增 8.7%，前值 8.2%。12 月份社会融资规模增量为 2.1 万亿元 比上年同期多 1719 亿元。12 月份，人民币贷款增加 1.14 万亿元，同比多增 543 亿元。

今日发行的 1 年期、3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.2449%、2.9226%、3.2007%、3.6226%，全场倍数分别为 3.97 倍、2.89 倍、4.38 倍、3.73 倍，边际倍数分别为 3.33 倍、1.39 倍、23 倍、3.23 倍。下午发行的 1 年期、3 年期、7 年期国开债固息增发债中标利率分别为 2.3674%、2.8930%、3.4292%，全场倍数分别为 2.50 倍、3.41 倍、3.17 倍，边际倍数分别为 24 倍、5.92 倍、12.5 倍。国债期货早盘探底回升，午后维持震荡。10 年期国债期货主力合约 T2003 收报 98.450，较上个交易日下跌 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF2003 收报 100.130，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2003 收报 100.460 较上个交易日持平。今日现券收益率窄幅震荡，金融数据公布后未激起波澜。截至目前，剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.5350%/3.5330%，剩余期限 9.35 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.1300%/3.1175%。

周四人民币兑美元中间报价 6.8807，较上个交易日上调 38 点。在岸、离岸人民币兑美元双双早盘震荡走低，尾盘止跌回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8850，较上个交易日官方收盘价上涨 21 点。离岸人民币兑美元现报 6.8844，较上个交易日收盘价上涨 76 点，目前两岸汇差倒挂在 6 点附近。美元指数全天震荡上行，午后 16:00 左右起跳水，现报 97.14，较上个交易日下跌 0.08%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Dshlin Dong

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

扫描二维码 轻松查看晨报及更多资讯



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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN