



【2021-02-18】

今日央行开展了 2000 亿元中期借贷便利 (MLF) 操作和 200 亿 7 天期逆回购操作, 另有 MLF 到期 2000 亿, 逆回购到期 2800 亿, 资金净回笼 2600 亿元。Shibor 利率涨跌互现, 其中隔夜品种报 2.3410%, 上涨 41.60 个基点; 7 天品种报 2.2130%, 下跌 0.40 个基点; 1 个月品种报 2.7530%, 下跌 0.10 个基点; 3 个月品种报 2.8150%, 上涨 0.30 个基点。今日资金面均衡偏松, 大行国股有部分融出。

今日下午发行的 1 年期[210201Z3.IB]、3 年期[210202Z5.IB]、10 年期[200215Z14.IB]国开行增发固息金融债券中标利率分别为 2.6568%、3.2359%、3.7265%, 全场倍数分别为 3.99 倍、4.92 倍、3.47 倍, 边际倍数为 1.04 倍、1.11 倍、2.01 倍。国债期货低开后低位震荡, 10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 96.765, 较上个交易日下跌 0.35%; 5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.170, 较上个交易日下跌 0.10%; 2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.155, 较上个交易日下跌 0.06%。今日现券收益率早盘大幅上行, 午后上行幅度有所收敛。截至目前, 剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.765%/3.765%, 剩余期限 9.75 年的国开债活跃券 200016 收益率报 3.28%/3.275%。

周四美元兑人民币中间价报 6.4536, 较上个交易日上调 145 点。在岸美元兑人民币早盘高开并高位震荡, 午后快速走高。截至 16:30, 在岸美元兑人民币收报 6.4706, 较上一交易日涨 326 个基点; 离岸美元兑人民币早盘震荡走高, 午后涨幅进一步扩大, 现报 6.4600, 较上个交易日收盘价升值 241 点, 目前两岸汇差倒挂在 106 点附近。美元指数震荡下行, 尾盘跌幅扩大, 现报 90.76, 较上个交易日下跌 0.17%。

上周最后一个交易日 (2 月 10 日) CFETS 人民币汇率指数录得 96.66, 按周下跌 0.29; 参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 100.67, 按周下跌 0.19; 参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.00, 按周下跌 0.11。

以上仅供参考, 谢谢!

文/Jason Mao

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