

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

【2021-01-08】

财经新闻

(1) 中国 12 月外汇储备规模为 32165 亿美元。国家外汇管理局数据显示，截至 2020 年 12 月末，中国外汇储备规模为 32165 亿美元，较 11 月末上升 380 亿美元，升幅为 1.2%。12 月，中国外汇市场运行总体稳定，市场交易理性有序。

(2) 央行、外汇局调整企业跨境融资宏观审慎调节参数。中国人民银行、国家外汇管理局 7 日决定，将企业的跨境融资宏观审慎调节参数由 1.25 下调至 1。人民银行、外汇局当日发布关于调整企业跨境融资宏观审慎调节参数的通知，通知自发布之日起实施。企业因此次参数调整导致跨境融资风险加权余额超出上限的，通知发布之前的跨境融资合约可持有到期。

(3) 中央结算公司：2020 年外资净增持人民币债券超万亿元。中央结算公司最新数据显示，境外机构投资者 2020 年 12 月增持 1185.08 亿元人民币债券，这也是境外机构投资者连续第 25 个月增持中国债券。据统计，2020 年，境外机构投资者增持人民币债券资金量已超过万亿元。

(4) 美国上周首次申领失业救济 78.7 万人，预期 80 万人。当地时间 1 月 7 日，美国劳工局公布美国最新的当周初请失业金等数据情况。截至 1 月 2 日当周，美国初请失业金人数 78.7 万人，好于预期的 80 万人，前值经修正后上调了 3000 人至 79 万人。这意味着，与修正后的前一周数据（截至 2019 年 12 月 26 日当周）相比，美国截至 1 月 2 日当周的初请失业金人数有 3000 人的小幅度下降。

市场动态

(1) 周四央行开展了 100 亿元 7 天期逆回购操作，有 1200 亿元逆回购到期，逆回购资金净回笼 1100 亿元。今日无逆回购到期。周四资金面呈宽松态势，早盘隔夜期限资金供给充裕，午后资金面持续宽松直至收盘。

(2) 周四债市交投活跃，期货震荡下行，现券收益率窄幅震荡，10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 98.125，较上个交易日上涨 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.935，较上个交易日上涨 0.06%；剩余期限 9.79 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.53%/3.52%。

(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 6.4779 元，较上个交易日夜盘收盘贬值 139 点。成交量 390.94 亿美元，较上个交易日增加 18.44 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 21 贴现国债 01 等国债共 2 只，计划发行规模 600 亿；21 大连债 01 等地方政府债共 2 只，计划发行规模 225 亿；21 兴业银行 CD014 等同业存单共 101 只，计划发行规模 606.50 亿；21 进出 02 等金融债共 6 只，计划发行规模 198 亿；21 肥西城投债 01 共 1 只，计划发行规模 7 亿；21 邹城资产 MTN001 中期票据共 1 只，计划发行规模 1 亿；21 大唐环境 SCP001 等短期融资券 8 只，计划发行规模 37 亿；共计 121 只债券发行，计划发行规模 1674.5 亿。

评级动态

无。

以上仅供参考，谢谢！

文/Neal Tao

如果您对本文章有任何评论与见解
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



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