



【2020-12-11】

今日央行开展了 100 亿元逆回购操作，有 100 亿元逆回购到期，逆回购资金零投放零回笼。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 1.4310%，较上个交易日上涨 45.20 个基点；7 天品种报 2.1780%，较上个交易日上涨 11.50 个基点；1 个月品种报 2.7120%，较上个交易日持平；3 个月品种报 3.0160%，较上个交易日下跌 0.80 个基点。今日资金面呈均衡宽松态势，早盘延续昨日紧张态势，午后资金面趋于宽松直至收盘。

今日早间发行 3 个月期贴现国债中标利率为 2.6900%，边际利率为 2.7299%，全场倍数为 2.81 倍，边际倍数为 3.66 倍；30 年期附息国债中标利率为 3.8243%，全场倍数为 2.94 倍，边际倍数为 1.82 倍，同时发行的 5 年期进出口行固息增发债中标利率为 3.3421%，全场倍数为 5.20 倍，边际倍数为 2.86 倍。国债期货早盘低开，随后持续震荡走低，10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 97.215，较上个交易日下跌 0.40%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.325，较上个交易日下跌 0.22%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.150，较上个交易日下跌 0.09%。今日现券收益率上行。截至目前，剩余期限 9.86 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.7175%/3.715%，剩余期限 9.94 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.295%/3.2925%。

周五人民币兑美元中间报价 6.5405，较上个交易日上调 71 点。在岸人民币兑美元全天震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.5411，较上个交易日官方收盘价升值 69 点。离岸人民币兑美元早盘高位震荡，午后震荡走低，现报 6.5306，较上个交易日收盘价升值 50 点，目前两岸汇差倒挂在 105 点附近。美元指数早盘震荡下行，北京时间下午 3 时后直线拉升，现报 90.94，较上个交易日上涨 0.18%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Neal Tao

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