



【2020-01-06】

今日央行发公告称，下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点，释放长期资金 8000 多亿元。银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收央行逆回购到期等因素的影响，不开展逆回购操作。今日逆回购到期 500 亿，逆回购资金净回笼 500 亿元。Shibor 利率全线下跌，其中隔夜品种报 1.0030%，较上个交易日下跌 15.90 个基点；7 天品种报 2.2190%，较上个交易日下跌 13.00 个基点；1 个月品种报 2.7470%，较上个交易日下跌 9.50 个基点；3 个月品种报 2.9200%，较上个交易日下跌 4.00 个基点。今日隔夜押利率融出较多，全天表现宽松；7 天到一个月期限较为宽松，价格变化有限。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.8517%、3.2314%，全场倍数分别为 3.97 倍、4.57 倍，边际倍数分别为 2.89 倍、1.06 倍。国债期货早盘持稳，随后震荡走高，临近尾盘下行。10 年期国债期货主力合约 T2003 收报 98.180，较上个交易日上涨 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF2003 收报 99.920，较上个交易日上涨 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS2003 收报 100.345，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率小幅下行。截至目前，剩余期限 9.70 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.5750%/3.5725%，剩余期限 9.38 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.1700%/3.1575%。

周一人民币兑美元中间报价 6.9718，较上个交易日下调 37 点。在岸、离岸人民币兑美元双双全天震荡走低，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9745，较上个交易日官方收盘价下跌 29 点。离岸人民币兑美元现报 6.9736，较上个交易日收盘价下跌 65 点，目前两岸汇差倒挂在 9 点附近。美元指数全天震荡，现报 96.84，较上个交易日下跌 0.05%。

上周最后一个交易日（1 月 3 日）CFETS 人民币汇率指数录得 91.51，按周下跌 0.14；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.19，按周下跌 0.18；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 91.17，按周下跌 0.12。

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