



【2020-02-17】

今日央行发公告称，为对冲央行逆回购到期等因素的影响，维护银行体系流动性合理充裕，人民银行开展了 2000 亿元中期借贷便利 (MLF) 操作和 1000 亿元 7 天期逆回购操作。今日逆回购到期 1 万亿，全口径资金净回笼 7000 亿。Shibor 利率短端上涨，长端下跌，其中隔夜品种报 1.4250%，较上个交易日上涨 16.90 个基点；7 天品种报 2.2610%，较上个交易日上涨 2.80 个基点；1 个月品种报 2.4000%，较上个交易日下跌 1.60 个基点；3 个月品种报 2.5450%，较上个交易日下跌 2.00 个基点。今日有资金回笼，隔夜至 1 个月期限较上个交易日略微收紧，供给减少，但需求基本能得到满足。1 个月以上更长期限，交投较为清淡。

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 2.5114%、2.9567%，全场倍数分别为 5.10 倍、3.89 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、12.50 倍。国债期货全天震荡走低。10 年期国债期货主力合约 T2006 收报 99.745，较上个交易日下跌 0.26%；5 年期国债期货主力合约 TF2003 收报 101.255，较上个交易日下跌 0.12%；2 年期国债期货主力

合约 TS2003 收报 101.045，较上个交易日下跌 0.04%。今日现券收益率震荡上行。截至目前，剩余期限 9.59 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.2925%/3.2925%，剩余期限 9.26 年的国债活跃券 190006 收益率报 2.9200%/2.9150%。

周一人民币兑美元中间报价 6.9795，较上个交易日上调 48 点。在岸人民币兑美元早盘冲高小幅回落，午后下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9807，较上个交易日官方收盘价下跌 12 点。离岸人民币兑美元早盘震荡上行，随后持稳，午后走弱，现报 6.9838，较上个交易日收盘价上涨 92 点，目前两岸汇差在 31 点附近。美元指数全天震荡，现报 99.12，较上个交易日下跌 0.04%。

上周最后一个交易日(2月14日)CFETS 人民币汇率指数录得 92.85，按周上涨 0.14；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.42，按周上涨 0.15；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.89，按周上涨 0.24。

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