



【2019-12-30】

今日央行发公告称，年末财政支出力度进一步加大，银行体系流动性总量处于较高水平，不开展逆回购操作。今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率短端上涨，长端下跌，其中隔夜品种报 1.2000%，较上个交易日上涨 12.50 个基点；7 天品种报 2.6180%，较上个交易日上涨 3.90 个基点；1 个月品种报 2.9755%，较上个交易日下跌 1.55 个基点；3 个月品种报 3.0210%，较上个交易日下跌 0.45 个基点。今日隔夜期限表现较为宽松，押存单与信用融入需求较多，午后押信用隔夜稍有收紧。跨年期限早盘有押利率成交，随后以押信用成交为主。

今日国债期货早盘低开低走，随后震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T2003 收报 98.200，较上个交易日持平；5 年期国债期货主力合约 TF2003 收报 99.950，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2003 收报 100.420，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率早盘高开，随后维持横盘整理态势，尾盘小幅下行。截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.5800%/3.5775%，剩余期限 9.40 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.1525%/3.1500%。

周一人民币兑美元中间报价 6.9805，较上个交易日上调 74 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘双双冲高，午后回落，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9878，较上个交易日官方收盘价上涨 114 点。离岸人民币兑美元现报 6.9831，较上个交易日收盘价上涨 83 点，目前两岸汇差倒挂在 47 点附近。美元指数早盘走弱，午后震荡上行，现报 96.83，较上个交易日下跌 0.18%。

上周最后一个交易日（12 月 27 日）CFETS 人民币汇率指数录得 91.65，按周上涨 0.15；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.37，按周上涨 0.19；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.09，按周上涨 0.28。

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