

市场概述 晨报

常规报告系列



【2020-01-03】

财经新闻

- (1) **外汇交易中心：2月24日起试运行利率期权交易及相关服务。** 外汇交易中心昨日公告，全国银行间同业拆借中心将于2020年2月24日起试运行利率期权交易及相关服务。交易时间为每周一至周五（国家法定节假日调整除外）北京时间9:00-12:00，13:30-17:00。交易品种有挂钩LPR1Y/LPR5Y的利率互换期权、利率上/下限期权。期权类型为欧式期权。
- (2) **韩正召开财税部门座谈会。** 据新华社，1月2日韩正召开财税部门座谈会强调：巩固拓展减税降费成效，从严从紧管好财政支出，确保全面建成小康社会和“十三五”规划圆满收官。要把减税降费政策落实落细，在执行过程中深化完善，力求更好成效。坚持“以收定支”，从严从紧管好财政支出，加强预算绩效管理，做到花钱要问效，有效多安排、低效多压减、无效要问责。要完善相关工作机制，积极稳妥防范和化解地方政府债务风险。坚持市场化法治化原则，依法处置和化解金融风险。
- (3) **美国12月Markit制造业PMI终值52.4，预期52.5，初值52.5。** 北京时间周四晚，美国公布12月Markit制造业PMI产出分项指数终值52.4，初值52.4；11月终值53.7。美国12月Markit制造业PMI新订单分项指数终值53.1，初值53.2；11月终值53.6。

市场动态

- (1) 周四央行不开展逆回购操作，逆回购到期4000亿，资金净回笼4000亿。今日逆回购到期1500亿。周四资金面依旧维持宽松态势；早盘21天以内资金银行大量融出，平盘需求很快被满足，隔夜随后有减点融出；跨春节期限表现均衡。午后资金面依旧宽松，持续到尾盘。
- (2) 周四债市交投较活跃，期货全天震荡，午后小幅下挫，收益率较上个交易日略有上行。10年期国债期货主力合约T2003收报98.015，较上个交易日下跌0.14%；5年期国债期货主力合约TF2003收报99.860，较上个交易日下跌0.09%；剩余期限9.72年的国开债活跃券190215收益率报--/3.5875%。
- (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6.9643元，较上个交易日夜盘收盘跌11点。成交量327.44亿美元，较上个交易日增加165.23亿美元。

一级市场

今日银行间市场有20贴现国债01等国债2只，计划发行规模200.00亿；20兴业银行CD001等同业存单9只，计划发行规模89.60亿；19进出07（增6）等金融债6只，计划发行规模270.00亿；20杭金投MTN001等中期票据3只，计划发行规模25.00亿；20平安租赁SCP001等短期融资券18只，计划发行规模243.00亿；共计38只债券发行，计划发行规模827.60亿。

评级动态

无

以上仅供参考，谢谢！

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