



【2020-12-07】

今日央行开展了 500 亿元逆回购操作，有 1500 亿元逆回购和 3000 亿元 MLF 到期，全口径资金净回笼 4000 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 1.3660%，较上个交易日上涨 28.00 个基点；7 天品种报 2.1190%，较上个交易日上涨 0.30 个基点；1 个月品种报 2.7000%，较上个交易日上涨 0.40 个基点；3 个月品种报 3.0760%，较上个交易日下跌 0.70 个基点。今日资金面呈均衡宽松态势，早盘国股大行少量融出，午后资金面趋于宽松直至收盘。

今日海关总署发布数据显示，中国 11 月（以美元计）出口同比增 21.1%，预期增 9.5%，前值增 11.4%；进口同比增 4.5%，预期增 4.3%，前值增 4.7%；贸易顺差 754.2 亿美元，前值 584.4 亿美元。中国 11 月（以人民币计）出口同比增 14.9%，前值增 7.6%；进口同比降 0.8%，前值增 0.9%；贸易顺差 5071 亿元，前值 4017.5 亿元。

今日国债期货早盘低开，随后持续低位震荡，10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 97.310，较上个交易日下跌 0.14%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.290，较上个交易日下跌 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.105，较上个交易日下跌 0.03%。今日现券收益率下行。截至目前，剩余期限 9.87 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.7125%/3.71%，剩余期限 9.95 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.27%/3.27%。

周一人民币兑美元中间报价 6.5362，较上个交易日上调 145 点。在岸人民币兑美元持续震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.5382，较上个交易日官方收盘价贬值 80 点。离岸人民币兑美元震荡走低，现报 6.5273，较上个交易日收盘价贬值 105 点，目前两岸汇差倒挂在 109 点附近。美元指数早盘触底反弹，北京时间下午四点后直线拉升，现报 91.08，较上个交易日上涨 0.31%。

上周最后一个交易日（12 月 4 日）CFETS 人民币汇率指数录得 95.19，按周跌 0.40；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 99.01，按周跌 0.46；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.43，按周跌 0.39。

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