



【2021-01-28】

今日央行公开市场进行 1000 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2500 亿，资金净回笼 1500 亿。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 3.0240%，上涨 5.40 个基点；7 天品种报 2.9810%，上涨 1.20 个基点；1 个月品种报 2.7080%，上涨 7.60 个基点；3 个月品种报 2.7050%，上涨 8.60 个基点。今日资金面延续昨日紧张状态，大行国股无资金融出，各期限资金供给稀少，显著提价。

今日财政部公布了 2020 年全年财政收支情况。据统计，收入方面，2020 年，全国一般公共预算收入 182895 亿元，同比下降 3.9%；全国政府性基金预算收入 93489 亿元，同比增长 10.6%；全国国有资本经营预算收入 4778 亿元，同比增长 20.3%。支出方面，全国一般公共预算支出 245588 亿元，同比增长 2.8%；全国政府性基金预算支出 117999 亿元，同比增长 28.8%；全国国有资本经营预算支出 2544 亿元，同比增长 10.8%。

今日早盘发行的发行的 90 天期[2103663.IB]进出口行贴现金融债、3 年期[200313Z4.IB]、5 年期[200315Z13.IB]、10 年期[200410Z8.IB]进出口行发金融债券中标利率分别为 2.1322%、3.1888%、3.3435%、3.6595%，全场倍数分别为 5.78 倍、2.81 倍、3.99 倍、3.88 倍，边际倍数为 2.5 倍、1 倍、1 倍、1 倍。今日午后发行的 1 年期[210201Z.IB]、10 年期[200215Z12.IB]国开行增发金融债中标利率分别为 2.7939%、3.5617%，全场倍数分别为 3.67 倍、3.94 倍，边际倍数为 1.04 倍、2.96 倍。今日国债期货低开后震荡走低。10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 97.680，较上个交易日下跌 0.30%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.555，较上个交易日下跌 0.22%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.245，较上个交易日下跌 0.09%。今日现券收益率一路上行。截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.605%/3.6025%，剩余期限 9.80 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.1975%/3.1925%。

周四人民币兑美元中间价报 6.4845，较上个交易日下调 180 点。在岸人民币兑美元低开后震荡走高，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4758，较上个交易日官方收盘价下跌 87 点；离岸人民币全天宽幅震荡，离岸人民币兑美元现报 6.4959，较上个交易日收盘价升值 14 点，目前两岸汇差在 201 点附近。美元指数震荡走高，现报 90.75，较上个交易日上涨 0.18%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Jason Mao

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