



【2020-01-14】

今日央行发公告称，目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，可吸收政府债券发行缴款等因素的影响，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 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.5180%，较上个交易日上涨 45.90 个基点；7 天品种报 2.6540%，较上个交易日上涨 13.20 个基点；1 个月品种报 2.7060%，较上个交易日上涨 8.70 个基点；3 个月品种报 2.8620%，较上个交易日上涨 0.40 个基点。今日早盘大行股份制融出较少，随后全天紧张，价格大幅上行，午后 16:30 后有融出，尾盘仍有机构头寸未平；一个月以及更长期限需求较少，价格持稳。

海关总署数据显示，12 月份进出口规模达到了 3.01 万亿元，12 月当月同比增速为 12.7%。其中，出口 1.67 万亿元，增长 9%；进口 1.34 万亿元，增长 17.7%。2019 年，中国货物贸易进出口总值 31.54 万亿元人民币，比 2018 年增长 3.4%。其中，出口 17.23 万亿元，增长 5%；进口 14.31 万亿元，增长 1.6%；贸易顺差 2.92 万亿元，扩大 25.4%。

今日发行的 5 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 3.2062%、3.4969%，全场倍数分别为 3.03 倍、2.95 倍，边际倍数分别为 2.24 倍、2.08 倍。下午农发行在上交所发行的 2 年期固息增发债，中标利率为 2.6873%，全场倍数为 3.28 倍，边际倍数为 1.35 倍。国债期货早盘低开，随后全天震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T2003 收报 98.440，较上个交易日下跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2003 收报 100.130，较上个交易日下跌 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2003 收报 100.450，较上个交易日下跌 0.05%。今日现券收益率震荡走升。截至目前，剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.5475%/3.5425%，剩余期限 9.36 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.1300%/3.1275%。

周二人民币兑美元中间报价 6.8954，较上个交易日上调 309 点。在岸人民币兑美元早盘冲高，随后震荡下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8854，较上个交易日官方收盘价上涨 88 点。离岸人民币兑美元早盘探底回升，随后震荡走低，现报 6.8873，较上个交易日收盘价下跌 50 点，目前两岸汇差在 19 点附近。美元指数全天震荡，现报 97.40，较上个交易日上涨 0.02%。

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