市场概述
每日市场动态

常规报告系列

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2020-09-21】

今日央行开展了 1000 亿元 7 天期和 400 亿元 14 天期逆回购操作，有 800 亿元逆回购到期，逆回购资金净投放 600 亿元。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 2.2040%，较上个交易日上涨 10.30 个基点；7 天品种报 2.2620%，较上个交易日上涨 2.90 个基点；1 个月品种报 2.6190%，较上个交易日上涨 1.00 个基点；3 个月品种报 2.6730%，较上个交易日下跌 0.60 个基点。今日资金面全天紧张，早盘延续上个交易日紧张态势，国股大行隔夜期限融出稀少，午后资金面紧张态势有所加剧直至收盘。

中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布，2020 年 9 月 21 日贷款市场报价利率（LPR）为：1 年期 LPR 为 3.85%，5 年期以上 LPR 为 4.65% ，两个期限品种报价均与上个月持平。同时央行以利率招标方式进行了 2020 年中央国库现金管理商业银行定期存款（三期）招投标，中标总量 800 亿元，1 个月国库现金定存中标利率为 3%，前次为 2.7%。

今日早间发行的农发行 3 年期固息增发债、5 年期固息新发债中标利率分别为 3.2028%、3.4500%，全场倍数分别为 7.32 倍、6.76 倍，边际倍数分别为 1.53 倍、6.38 倍。国债期货高开高走，大幅上行，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 98.255，较上个交易日上涨 0.43%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 100.205，较上个交易日上涨 0.29%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.475，较上个交易日上涨 0.10%。今日现券收益率震荡下行。截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.655%/3.655%，剩余期限 9.66 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.10%/3.0975%。

周一人民币兑美元中间报价 6.7595，较上个交易日下调 4 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘震荡走高，午后双双大幅下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7733，较上个交易日官方收盘价下跌 145 点。离岸人民币兑美元现报 6.7734，较上个交易日收盘价上涨 58 点，目前两岸汇差在 1 点附近。美元指数早盘震荡走低，纽约时间 3 时后直线拉升，现报 93.28，较上个交易日上涨 0.30%。

上周最后一个交易日（9 月 18 日）CFETS 人民币汇率指数录得 94.12，按周上涨 0.52；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.93，按周上涨 0.57；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 92.69，按周上涨 0.80。

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。