



【2020-11-16】

今日央行开展了 8000 亿元中期借贷便利（MLF）操作，无逆回购到期，有 2000 亿元 MLF 到期，全口径资金净投放 6000 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.2520%，较上个交易日下跌 27.10 个基点；7 天品种报 2.3390%，较上个交易日下跌 9.40 个基点；1 个月品种报 2.6820%，较上个交易日上涨 0.30 个基点；3 个月品种报 3.0020%，较上个交易日下跌 0.10 个基点。今日资金面呈均衡宽松态势，早盘隔夜期限资金供给少量，央行公开市场操作后，资金面逐渐宽松，午后持续宽松直至收盘。

今日国家统计局发布数据显示，中国 10 月规模以上工业增加值同比增 6.9%，预期增 6.5%，前值增 6.9%。10 月社会消费品零售总额同比增长 4.3%，预期增长 5.2%，前值增 3.3%。1-10 月固定资产投资（不含农户）同比增 1.8%，预期增 1.8%，1-9 月增 0.8%。

今日午后发行的 10 年期农发行固息增发债中标利率为 3.7209%，全场倍数为 4.42 倍，边际倍数为 1.21 倍。国债期货早盘高开，随后震荡走低，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 97.620，较上个交易日上涨 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 99.350，较上个交易日上涨 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.020，较上个交易日上涨 0.03%。今日现券收益率窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.59 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.7475%/3.745%，剩余期限 9.51 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.27%/3.265%。

周一人民币兑美元中间报价 6.6048，较上个交易日上调 237 点。在岸、离岸人民币兑美元双双震荡上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.5770，较上个交易日官方收盘价升值 374 点。离岸人民币兑美元现报 6.5722，较上个交易日收盘价升值 217 点，目前两岸汇差倒挂在 48 点附近。美元指数震荡走低，现报 92.51，较上个交易日下跌 0.23%。

上周最后一个交易日（11 月 13 日）CFETS 人民币汇率指数录得 95.56，按周跌 0.10；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 99.38，按周跌 0.09；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.57，按周涨 0.13。

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