



【2020-06-19】

今日央行开展了 700 亿元 7 天期逆回购操作，1100 亿元 14 天期逆回购操作，有 1000 亿逆回购到期，2400 亿元 MLF 到期，逆回购资金净投放 800 亿元。Shibor 利率全数上涨，其中隔夜品种报 2.1310%，较上个交易日上涨 0.80 个基点；7 天品种报 2.1470%，较上个交易日上涨 4.70 个基点；1 个月品种报 2.0480%，较上个交易日上涨 2.50 个基点；3 个月品种报 2.0950%，较上个交易日上涨 1.70 个基点。今日早盘隔夜流动性偏紧，7 天以上期限供给较充足。午后隔夜流动性趋于宽松，7 天以上期限则融出减少，趋于紧张。

今日发行的 1 年期、2 年期、7 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.2643%、2.5312%、3.3581%，全场倍数分别为 1.98 倍、2.73 倍、2.96 倍，边际倍数分别为 2.28 倍、1.00 倍、1.53 倍。随后发行的 3 个月期贴现国债加权中标利率为 1.8139%，边际利率为 1.8536%，全场倍数 4.52 倍，边际倍数为 2.22 倍，同时发行的 30 年期附息国债中标利率为 3.6173%，全场倍数为 2.29 倍，边际倍数为 1.75 倍。国债期货早盘持续震荡，午后震荡走低，尾盘直线反弹。10 年期国债期货主力合约 T2009 收报 100.220，较上个交易日

上涨 0.08% ;5 年期国债期货主力合约 TF2009 收报 101.370 ,较上个交易日上涨 0.03% ;
2 年期国债期货主力合约 TS2009 收报 101.040 ,较上个交易日下跌 0.01%。今日早盘现
券收益率早盘震荡上行 ,午后有所回落 ,截至目前 ,剩余期限 9.72 年的国开债活跃券
200205 收益率报 3.1525%/ 3.1500% ,剩余期限 9.92 年的国债活跃券 200006 收益率报
2.8750%/ 2.8650%。

周五人民币兑美元中间报价 7.0913 ,较上个交易日下调 10 点。在岸人民币兑美元
早盘震荡 ,午后拉升 ,随后维持震荡 ,截至 16:30 ,在岸人民币兑美元收报 7.0780 ,较上个
交易日官方收盘价上涨 32 点。离岸人民币兑美元早盘小幅走高 ,午后震荡走升 ,现报 7.0736 ,
较上个交易日收盘价上涨 88 点 ,目前两岸汇差倒挂在 44 点附近。美元指数震荡下行 ,午
后有所反弹 ,现报 97.39 ,较上个交易日下跌 0.07%。

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