



【2019-12-31】

今日央行发公告称，年末财政支出力度进一步加大，银行体系流动性总量处于较高水平，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 利率短端上涨、长端涨跌互现，其中隔夜品种报 1.6940%，较上个交易日上涨 49.40 个基点；7 天品种报 2.7370%，较上个交易日上涨 11.90 个基点；1 个月品种报 2.9785%，较上个交易日上涨 0.30 个基点；3 个月品种报 3.0200%，较上个交易日下跌 0.10 个基点。今日早盘资金面表现有所收紧，2 至 7 天期限股份制、大行有所融出，午后资金面趋松。

今日国债期货早盘探底回升，随后维持震荡，午后下行。10 年期国债期货主力合约 T2003 收报 98.135，较上个交易日下降 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2003 收报 99.950，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2003 收报 100.420，较上个交易日上涨 0.01%。今日债市交投清淡，现券收益率窄幅波动。截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.5800%/3.5700%，剩余期限 9.39 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.1550%/3.1500%。

周二人民币兑美元中间报价 6.9762，较上个交易日上调 43 点。在岸、离岸人民币兑美元全天双双震荡上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9662，较上个交易日官方收盘价上涨 216 点。离岸人民币兑美元现报 6.9672，较上个交易日收盘价上涨 175 点，目前两岸汇差在 10 点附近。美元指数早盘探底回升后维持震荡，午后下行，现报 96.68，较上个交易日下跌 0.10%。

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