

市场概述 每日市场动态

常规报告系列



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

【2019-12-16】

今日央行开展 MLF 操作 3000 亿元，比当日到期量多 140 亿元。今日 MLF 到期 2860 亿，全口径资金净投放 140 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.4370%，较上个交易日上涨 30.40 个基点；7 天品种报 2.5315%，较上个交易日上涨 5.75 个基点；1 个月品种报 2.9304%，较上个交易日上涨 1.74 个基点；3 个月品种报 3.0324%，较上个交易日下跌 0.01 个基点。今日月内期限融出变少，午后隔夜收紧，整体呈现均衡态势；跨年期限成交主要集中在 28 天以及 1 个月期限，价格较上个交易日上行；跨春节期限需求较多，成交较少。

国家统计局网站 12 月 16 日公布数据显示，规模以上工业增加值同比实际增长 6.2%，预期 5.2%，前值 4.7%；11 月份，社会消费品零售总额同比增长 8.0%，预期 7.8%，前值 7.2%，其中，除汽车以外的消费品零售额增长 9.1%；中国 1-11 月固定资产投资同比增长 5.2%，1-10 月增速为 5.2%；中国 1-11 月房地产开发投资同比增长 10.2%，1-10 月增长 10.3%。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.9879%、3.3220%，全场倍数分别为 2.75 倍、2.85 倍，边际倍数分别为 2.08 倍、2.48 倍。国债期货早盘探底回升，午后震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2003 收报 97.765，较上个交易日下跌 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2003 收报 99.635，较上个交易日下跌 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2003 收报 100.220，较上个交易日下跌 0.01%。今日现券收益率窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.76 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.5950%/3.5930%，剩余期限 9.43 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.2000%/3.1950%。

周一人民币兑美元中间报价 6.9915，较上个交易日上调 241 点。在岸人民币兑美元早盘低开上行，随后全天震荡走低，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0027，较上个交易日官方收盘价下跌 188 点。离岸人民币兑美元早盘震荡走高，午后回落，现报 7.0028，较上个交易日收盘价上涨 23 点，目前两岸汇差在 1 点附近。美元指数早盘走弱，午后上行，现报 97.04，较上个交易日下跌 0.12%。

上周最后一个交易日（12 月 13 日）CFETS 人民币汇率指数录得 91.32，按周下降 0.08；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.96，按周下降 0.14；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 91.19，按周下降 0.05。

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