



【2020-02-21】

今日央行发公告称，目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，人民银行不开展逆回购操作。今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率全线下跌，其中隔夜品种报 1.3550%，较上个交易日下跌 4.80 个基点；7 天品种报 2.2450%，较上个交易日下跌 6.30 个基点；1 个月品种报 2.3430%，较上个交易日下跌 1.60 个基点；3 个月品种报 2.4890%，较上个交易日下跌 1.10 个基点。今日资金面整体延续上个交易日宽松态势。隔夜至 1 个月期限有大行持续融出。更长期限交投清淡。

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 1.7798%、2.4495%、3.2600%，全场倍数分别为 7.62 倍、4.26 倍、4.17 倍，边际倍数分别为 4.17 倍、1.06 倍、1.22 倍。下午发行的 91 天期贴现国债加权中标利率为 1.6562%，边际利率为 1.7207%，全场倍数为 3.31 倍，边际倍数为 1.09 倍。国债期货早盘高开，全天震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T2006 收报 100.230，较上个交易日上涨 0.40%；5 年期国债期货主力合约 TF2006 收报 101.020，较上个交易日上涨 0.21%；2 年期国债期货主力合

约 TS2006 收报 100.810，较上个交易日上涨 0.05%。今日现券收益率震荡下行。截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.2675%/3.2650%，剩余期限 9.25 年的国债活跃券 190006 收益率报 --/2.8600%。

周五人民币兑美元中间报价 7.0210，较上个交易日下调 184 点。在岸人民币兑美元全天震荡下行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0386，较上个交易日官方收盘价下跌 233 点。离岸人民币兑美元早盘探底回升，随后震荡下行，现报 7.0470，较上个交易日收盘价下跌 19 点，目前两岸汇差在 84 点附近。美元指数全天震荡走弱，午后跌幅扩大，现报 99.65，较上个交易日下跌 0.24%。

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