常规报告系列

市场概述
每日市场动态

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

【2020-01-17】

今日央行发公告称，为对冲现金投放高峰、政府债券发行缴款等因素的影响,维护春节前银行体系流动性合理充裕，人民银行开展了 2000 亿元 14 天期逆回购操作。今日无逆回购到期，逆回购资金净投 2000 亿。Shibor 利率短端下跌，长端持稳，其中隔夜品种报 2.5220%，较上个交易日下跌 8.70 个基点；7 天品种报 2.6400%，较上个交易日下跌 2.30 个基点；1 个月品种报 2.8080%，较上个交易日上涨 0.80 个基点；3 个月品种报 2.8680%，较上个交易日持平。今日资金面整体呈现均衡偏松态势，早盘大行股份制融出隔夜，隔夜总体供需均衡。14 天至 21 天跨春节期限较为宽松，融出居多，价格较上个交易日下行。

统计局发布数据显示，中国 2019 年 GDP 同比增长 6.1%，2018 年增速为 6.6%。2019 年 1-12 月，全国固定资产投资同比增长 5.4%，增速比 1—11 月份加快 0.2 个百分点。12 月份规模以上工业增加值同比实际增长 6.9%，增速比 11 月份加快 0.7 个百分点。12 月社会消费品零售总额同比增长 8%，前值 8%。

今日发行的 91 天期贴现国债加权中标利率为 1.9650%，边际利率为 2.0373%，全场倍数为 4.13 倍，边际倍数为 1.36 倍。国债期货早盘震荡走低，经济数据公布后跌幅扩大，随后震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T2003 收报 98.620，较上个交易日上涨 0.16%；5 年期国债期货主力合约 TF2003 收报 100.250，较上个交易日上涨 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS2003 收报 100.545，较上个交易日上涨 0.07%。今日现券收益率先升后降。截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 190215 收益率报 3.5275%/3.5275%，剩余期限 9.35 年的国债活跃券 190006 收益率报 3.1175%/3.1000%。

周五人民币兑美元中间报价 6.8878，较上个交易日下调 71 点。在岸、离岸人民币兑美元双双全天震荡上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8585，较上个交易日官方收盘价上涨 265 点。离岸人民币兑美元现报 6.8645，较上个交易日收盘价上涨 124 点，目前两岸汇差倒挂 60 点附近。美元指数冲高回落，随后再次走高，午后回调，现报 97.30，较上个交易日下跌 0.02%。

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。