

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

【2021-01-14】

今日央行开展了 20 亿元 7 天期逆回购操作，有 100 亿元逆回购到期，逆回购资金净回笼 80 亿元。Shibor 利率短端上涨，长端下跌，其中隔夜品种报 1.6750%，较上个交易日上涨 27.40 个基点；7 天品种报 2.0130%，较上个交易日上涨 1.40 个基点；1 个月品种报 2.4040%，较上个交易日下跌 0.80 个基点；3 个月品种报 2.5820%，较上个交易日下跌 0.80 个基点。今日资金面延续宽松态势，国股大行大量融出隔夜期限，午后资金面持续宽松直至收盘。

今日海关总署发布数据显示，中国去年 12 月（以人民币计）出口同比增 10.9%，前值增 14.9%；进口同比降 0.2%，前值降 0.8%；贸易顺差 5168.1 亿元，前值 5071 亿元。去年 12 月（以美元计）出口同比增 18.1%，预期增 15.2%，前值增 21.1%；进口增 6.5%，预期增 4.6%，前值增 4.5%；贸易顺差 781.7 亿美元，前值 754 亿美元。2020 年中国进出口总值 32.16 万亿元人民币，同比增长 1.9%，规模再创历史新高。其中出口增长 4%，进口下降 0.7%，贸易顺差增加 27.4%。

今日早间发行的进出口行 3 个月期新发贴现债及 3 年期、5 年期、10 年期固息增发债中标利率分别为 1.6778%、2.8791%、3.1437%、3.5609%，全场倍数分别为 6.81 倍、4.6 倍、5.5 倍、4.26 倍，边际倍数分别为 3.33 倍、1.47 倍、2.54 倍、156.00 倍，午后发行的国开行 1 年期、10 年期固息增发债中标利率分别为 2.1015%、3.4672%，全场倍数分别为 3.94 倍、3.17 倍，边际倍数分别为 1.03 倍、6.86 倍，国债期货早盘大幅高开，随后冲高回落，午后再度拉升，10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 98.200，较上个交易日上涨 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 100.075，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.550，较上个交易日下跌 0.08%。今日现券收益率小幅下行。截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.5050%/3.5025%，剩余期限 9.85 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.1075%/3.1025%。

周四人民币兑美元中间报价 6.4746，较上个交易日下调 141 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘双双直线走低，随后震荡回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4678，较上个交易日官方收盘价贬值 19 点。离岸人民币兑美元现报 6.4657，较上个交易日收盘价升值 13 点，目前两岸汇差倒挂在 21 点附近。美元指数全天震荡，现报 90.31，较上个交易日下跌 0.02%。

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