

撰写人: 张昕 从业资格证号: F3073677 投资咨询从业证书号: Z0015602

项目类别	数据指标	最新	环比	项目	最新	环比
期货盘面	T主力收盘价	101.115	-0.11%	T主力成交量	52619	-16595↓
	TF主力收盘价	102.250	-0.05%	TF主力成交量	38316	-3771↓
	TS主力收盘价	101.345	0.02%	TS主力成交量	12694	-3262↓
期货价差	T 03-06价差	0.33	-0.03↓	TF03-T03价差	1.14	0.06↑
	TF03-06价差	0.22	-0.04↓	TS03-T03价差	0.23	0.13↑
	TS 03-06价差	0.05	+0.00↑	TS03-TF03价差	-0.91	0.08↑
期货持仓头寸 (手)	T主力持仓量	136549	-1978↓	T前20名多头	120,152	-584↓
	T前20名空头	135,808	880↑	T前20名净空仓	15,656	1464↑
	TF主力持仓量	85114	-1350↓	TF前20名多头	82,617	810↑
	TF前20名空头	90,603	1612↑	TF前20名净空仓	7,986	802↑
	TS主力持仓量	46350	-918↓	TS前20名多头	38,266	-394↓
	TS前20名空头	42,686	-536↓	TS前20名净空仓	4,420	-142↓
前二CTD (净价)	200006.IB (T)	99.0398	-0.0578↓	200003.IB (T)	99.0955	-0.1114↓
	220002.IB (TF)	99.7559	-0.1043↓	190007.IB (TF)	103.3839	-0.0448↓
	*报价截止16:00 180023.IB (TS)	101.902	0	210015.IB (TS)	100.7012	0.0085↑
国债活跃券* (%)	1y	2.1400	3.75↑bp	3y	2.1800	3.00↑bp
	5y	2.4325	3.75↑bp	7y	2.7650	6.00↑bp
	*报价截止16:20 10y	2.7300	6.00↑bp			
短期利率 (%)	银质押隔夜	1.5197	-8.03↓bp	Shibor隔夜	1.6140	-12.60↓bp
	银质押7天	1.5500	-52.00↓bp	Shibor7天	2.1200	3.20↑bp
	银质押14天	2.5725	5.25↑bp	Shibor14天	2.4620	-4.00↓bp
LPR利率(%)	1y	3.70	-10.00↓bp	5y	4.6	-5↓
公开市场操作	逆回购操作:					
	发行规模(亿)	2000	到期规模(亿)	1000	利率(%) / 天数	2.25/14
	逆回购净投放(亿)	1000				
行业消息	<p>1.国家卫健委: 昨日新增本土确诊病例25例, 其中浙江6例, 北京5例。浙江新增8例新冠肺炎本土确诊病例, 均在杭州市。</p> <p>2.A股收跌: 沪指失守3400点, 创业板指跌超3%, 两市逾4300只股票下跌, 北向资金净卖出近150亿元。</p> <p>3.中国12月规模以上工业企业利润同比增长4.2%。</p> <p>4.两部门发布关于促进云网融合、加快中小城市信息基础设施建设的通知。</p>					
	<p>瑞达期货研究院公众号</p> 					
	<p>股市疲弱未改变国债期货回调态势, 今日国债期货继续回调, 仅二债勉强收红。当前宏观经济政策正向逆周期调节转换, 在通胀压力缓解的情况下, 货币政策有较大宽松空间。在各项政策托底之下, 经济底正在形成, 下半年经济有望提速, 宽松货币政策有退出风险, 今年一季度是货币政策比较确定的宽松窗口期。目前 10 年期国债到期收益率已经降至 2.7%附近, 短期底部预计在 2.65%附近。技术面上看, 二债、五债、十债主力长期上涨趋势仍未发生变化, 但近两日放量减仓显示多单盈利平仓出场, 期债短线回调风险较大。操作上, 建议投资者国债期货多单继续减仓, 轻仓过节, 套利策略暂不建议。</p>					
	<p>瑞期研究客服</p> 					
观点总结	<p>1-27 21:30 美国四季度实际GDP年化季环比初值; 21:30 美国1月22日当周首次申请失业救济人数; 21:30 美国12月耐用品订单环比初值</p> <p>1-28 18:00 欧元区1月经济景气指数; 21:30 美国12月个人消费支出(PCE)环比; 23:00 美国1月密歇根大学消费者信心指数终值</p>					
	<p>重点关注的消息: 1-27 21:30 美国四季度实际GDP年化季环比初值; 21:30 美国1月22日当周首次申请失业救济人数; 21:30 美国12月耐用品订单环比初值; 1-28 18:00 欧元区1月经济景气指数; 21:30 美国12月个人消费支出(PCE)环比; 23:00 美国1月密歇根大学消费者信心指数终值</p>					

瑞达期货

+