

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	101.245	-0.22%	T主力成交量	69214	16737↑
	TF主力收盘价	102.325	-0.19%	TF主力成交量	42087	4434↑
	TS主力收盘价	101.345	-0.04%	TS主力成交量	15956	2869↑
期货价差	T 03-06价差	0.36	+0.02↑	TF03-T03价差	1.08	0.09↑
	TF03-06价差	0.27	+0.00↑	TS03-T03价差	0.10	0.23↑
	TS 03-06价差	0.05	+0.02↑	TS03-TF03价差	-0.98	0.14↑
期货持仓头寸 (手)	T主力持仓量	138527	-5062↓	T前20名多头	120,786	-681↓
	T前20名空头	135,100	32↑	T前20名净空仓	14,314	713↑
	TF主力持仓量	86464	-5191↓	TF前20名多头	82,298	-2079↓
	TF前20名空头	90,485	-2741↓	TF前20名净空仓	8,187	-662↓
	TS主力持仓量	47268	-1635↓	TS前20名多头	38,660	-1040↓
	TS前20名空头	43,232	-1063↓	TS前20名净空仓	4,572	-23↓
前二CTD (净价)	2000004.IB (T)	100.412	-0.1127↓	2000003.IB (T)	99.0955	-0.1116↓
	190016.IB (TF)	102.971	-0.2906↓	190007.IB (TF)	103.4277	-0.1444↓
	*报价截止16:00 180023.IB (TS)	101.905	-0.0804↓	210015.IB (TS)	100.7023	-0.0147↓
国债活跃券* (%)	1y	1.9800	0.50↑bp	3y	2.2300	-1.00↓bp
	5y	2.4500	3.00↑bp	7y	2.6250	1.50↑bp
	*报价截止16:20 10y	2.7150	1.75↑bp			
短期利率 (%)	银质押隔夜	1.7209	-17.91↓bp	Shibor隔夜	1.7400	-19.10↓bp
	银质押7天	2.0700	14.00↑bp	Shibor7天	2.0880	-0.50↓bp
	银质押14天	2.5200	2.20↑bp	Shibor14天	2.5020	1.30↑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	1.国家卫健委: 昨日新增本土确诊病例24例, 其中北京14例, 黑龙江4例, 新疆2例。 2.中国央行今日进行1500亿元14天期逆回购操作, 有100亿逆回购到期。 3.税务总局曝光5起涉税违法案件, 江西省九江市税务部门与公安部门联合依法查处一起虚开骗税案件, 抓获犯罪嫌疑人23名, 捣毁犯罪窝点16个。 4.A股收涨: 两市超3000股上涨, 创业板重回3000点, 券商、基建股午后发力。					瑞达期货研究院公众号 
	观点总结	央行近期降息利好有出尽迹象, 国债期货今日明显回调。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, 但今日均放量减仓, 显示多单盈利平仓出场, 期债短线回调风险加大。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。				
重点关注	1-26 21:30 美国12月商品贸易帐; 23:00 加拿大央行政策利率 1-27 03:00 美联储议息会议; 03:30 美联储主席鲍威尔召开货币政策新闻发布会; 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					

瑞达期货

+