



【2021-01-06】

今日央行开展了 100 亿元 7 天期逆回购操作，有 1400 亿元逆回购到期，逆回购资金净回笼 1300 亿元。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 0.6160%，较上个交易日下跌 11.30 个基点；7 天品种报 1.9660%，较上个交易日上涨 14.40 个基点；1 个月品种报 2.5290%，较上个交易日下跌 4.80 个基点；3 个月品种报 2.7070%，较上个交易日下跌 2.70 个基点。今日资金面延续宽松态势，隔夜期限资金供给充裕，午后资金面维持宽松直至收盘。

今日早间发行的 3 年期、7 年期附息国债中标利率分别为 2.7615%、3.1231%，边际利率分别为 2.7911%、3.1525%，全场倍数分别为 3.84 倍、3.62 倍，边际倍数分别为 4.25 倍、1.05 倍，午后发行的 1 年期、10 年期[160418Z21.IB]、10 年期[200410Z5.IB]农发行固息增发债中标利率分别为 2.2735%、3.2432%、3.6162%，全场倍数分别为 5.68 倍、3.00 倍、4.54 倍，边际倍数分别为 5.50 倍、2.17 倍、6.93 倍，国债期货早盘冲高，随后持续震荡走低，尾盘回升翻红，10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 98.105，较上个交易日上涨 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.905，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.430，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.79 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.53%/3.52%，剩余期限 9.87 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.1375%/3.12%。

周三人民币兑美元中间报价 6.4604，较上个交易日上调 156 点。在岸人民币兑美元早盘高开后直线跳水，随后持续震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4615，较上个交易日官方收盘价升值 25 点。离岸人民币兑美元早盘走低，随后持续震荡回升，现报 6.4442，较上个交易日收盘价贬值 72 点，目前两岸汇差倒挂在 173 点附近。美元指数早盘冲高，随后震荡下行，现报 89.35，较上个交易日下跌 0.13%。

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