

# 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

【2022-12-05】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 550 亿逆回购到期，当日资金净回笼 530 亿。Shibor 利率短端下行，其中隔夜品种报 1.0800%，下跌 7.70 个基点；7 天品种报 1.6890%，下跌 0.40 个基点；1 个月品种报 1.9290%，上涨 0.60 个基点；3 个月品种报 2.2010%，上涨 0.10 个基点。今日资金面整体均衡，国股大行有部分融出，月内资金价格整体下行。

今日下午发行 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.6332%、2.8113%，全场倍数分别为 2.76 倍、4.02 倍，边际倍数分别为 3.52 倍、1.57 倍。今日国债期货低开震荡回升，午后回落，尾盘再度反弹。10 年期国债期货主力合约 T2303 收报 99.590，较上个交易日下跌 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2303 收报 100.675，较上个交易日下跌 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS2303 收报 100.745，较上个交易日下跌 0.02%。今日主要现券收益率小幅上行后震荡，截至目前，剩余期限 9.62 年的国开债活跃券 220215 收益率报 3.0475%/3.0475%，剩余期限 9.75 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.9225%/2.9175%。

周一美元兑人民币中间价报 7.0384，较上个交易日下调 158 点。今日在岸美元兑人民币上午大幅低开后进一步下行，下午低位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.9561，较上一交易日下跌 819 个基点；离岸美元兑人民币上午大幅下行，午后低位震荡，现报 6.9521，较上一交易日下跌 735 个基点，目前两岸汇差倒挂在 40 个基点附近。美元指数上午大幅下行，午后大幅反弹转升，现报 104.57，较上一交易日上涨 0.06%。

上周最后一个交易日（12 月 2 日）CFETS 人民币汇率指数录得 97.39，按周上涨 0.14；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 102.65，按周下跌 0.05；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.25，按周上涨 0.33。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Jason Mao

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**