



【2023-02-06】

今日央行开展 1500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 5230 亿，当日资金净回笼 3730 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.7820%，上涨 52.00 个基点；7 天品种报 2.0070%，上涨 15.70 个基点；1 个月品种报 2.1740%，上涨 0.10 个基点；3 个月品种报 2.3590%，上涨 0.20 个基点。连续多日净回笼下，今日资金面较上个交易日有所收敛，各期限资金价格均有不同程度上升。

下午发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.7034%、2.8748%，全场倍数分别为 3.02 倍、3.22 倍，边际倍数分别为 1.07 倍、1.24 倍。国债期货全天窄幅震荡，小幅收跌。10 年期国债期货主力合约 T2303 收报 100.265，较上个交易日下跌 0.06%；5 年期国债期货主力合约 TF2303 收报 100.975，较上个交易日下跌 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2303 收报 100.885，较上个交易日下跌 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡下行，截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 220220 收益率报 3.06%/3.0575%，剩余期限 9.78 年的国债活跃券 220025 收益率报 2.9%/2.898%。

周一美元兑人民币中间价报 6.7737，较上个交易日大幅上调 355 点。今日在岸美元兑人民币回吐高开涨幅，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7832，较上一交易日上涨 367 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.7833，较上一交易日下跌 250 个基点，目前两岸汇差在 100 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 103.09，较上一交易日上涨 0.09%。

上周五（2 月 3 日）CFETS 人民币汇率指数录得 99.86，按周上涨 0.10；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 104.84，按周下跌 0.05；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.14，按周上涨 0.38。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui

如果您对本文有任何评论与见解
请发电邮至: SHOffice@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松查看更多资讯



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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息