



【2023-02-01】

今日央行开展 1550 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4470 亿，当日资金净回笼 2920 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.1190%，上涨 13.10 个基点；7 天品种报 2.0450%，下跌 7.60 个基点；1 个月品种报 2.2050%，下跌 2.20 个基点；3 个月品种报 2.3620%，下跌 0.20 个基点。资金面早盘均衡偏紧，日内边际改善，临近尾盘转为偏松，隔夜资金加权价格回到前期高位水平。

下午发行的 6 个月期、1 年期、10 年期农发行债中标利率分别为 1.9752%、2.1786%、3.1009%，全场倍数分别为 3.06 倍、2.95 倍、1.64 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、1.00 倍、1.00 倍。国债期货早盘短暂下行后小幅拉升，午盘维持震荡，尾盘回吐全部涨幅，全线收跌。10 年期国债期货主力合约 T2303 收报 100.110，较上个交易日下跌 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF2303 收报 100.925，较上个交易日下跌 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2303 收报 100.880，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率全天窄幅

震荡，小幅走升，截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 220220 收益率报

3.065%/3.0625%，剩余期限 9.79 年的国债活跃券 220025 收益率报 2.91%/2.9025%。

周三美元兑人民币中间价报 6.7492，较上个交易日下调 112 点。今日在岸、离岸美元兑人民币低位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7410，较上一交易日下跌 161 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.7429，较上一交易日下跌 125 个基点，目前两岸汇差在 30 个基点附近。美元指数震荡走弱，现报 101.94，较上一交易日下跌 0.17%。

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