

# 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

【2022-01-19】

今日央行开展 1000 亿 7 天期逆回购操作，有 100 亿逆回购到期，当日资金净投放 900 亿。Shibor 利率短期限上行，长期限下行，其中隔夜品种报 2.0350%，上涨 11.40 个基点；7 天品种报 2.1270%，上涨 3.90 个基点；1 个月品种报 2.4220%，较上一交易日下跌 0.50 个基点；3 个月品种报 2.4830%，较上个交易日下跌 1.00 个基点。今日资金面早盘均衡，午后国股大行融出减少，资金面一度边际趋紧，尾盘逐渐恢复均衡。

今日上午发行的 2 年期国开行上清所托管绿色固息债，中标利率为 2.4500%，全场倍数为 3.36 倍，边际倍数为 18.85 倍。稍后发行的 2 年期付息续发国债、5 年期付息国债中标利率分别为 2.1292%、2.3700%，边际利率分别为 2.1618%、2.4000%，全场倍数分别为 5.37 倍、3.81 倍，边际倍数分别为 6.75 倍、1.05 倍。下午发行 1 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 1.8617%、3.0024%，全场倍数分别为 3.84 倍、4.58 倍，边际倍数分别为 1.37 倍、1.85 倍。今日国债期货上午高开后高位震荡，午后震荡下行，涨幅有所收窄。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 101.245，较上个交易日上涨 0.22%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 102.275，较上个交易日上涨 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.325，较上个交易日上涨 0.05%。今日现券收益率早盘快速下行，后震荡，下午小幅震荡回升，截至目前，剩余期限 9.65 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.035%/3.035%，剩余期限 9.83 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.735%/2.73%。

周三美元兑人民币中间价报 6.3624，较上个交易日上调 103 点。今日在岸美元兑人民币上午冲高回落，后震荡下行转跌，下午 15:00 后快速反弹转升，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3522，较上一交易日升值 9 个基点；离岸美元兑人民币震荡下行，现报 6.3550，较上一交易日贬值 50 个基点，目前两岸汇差在 28 个基点附近。美元指数上午震荡，午后快速下行后震荡，现报 95.68，较上个交易日贬值 0.06%。

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**