



【2021-01-25】

今日央行公开市场进行 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，资金零投放零回笼。Shibor 利率全线小幅上涨，其中隔夜品种报 2.4500%，上涨 1.40 个基点；7 天品种报 2.2960%，上涨 2.50 个基点；1 个月品种报 2.5120%，上涨 0.90 个基点；3 个月品种报 2.5790%，上涨 0.10 个基点。今日资金面整体偏紧。早盘资金面均衡，午盘资金面开始偏紧，大行国股暂停融出。

今日下午发行的 3 年期[200407Z16.IB]、5 年期[200408Z9.IB]农发行增发金融债券中标利率分别为 3.0206%、3.2324%，全场倍数分别为 3.88 倍、4.01 倍，边际倍数分别为 1.74 倍、1.23 倍。国债期货早盘低开，上午维持低位震荡，午后回升，收盘升幅回落。10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 98.335，较上个交易日上涨 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 100.010，较上个交易日下跌 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.475，较上个交易日下跌 0.01%。今日现券收益率小幅上行。截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.5275%/3.5275%，剩余期限 9.82 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.1325%/3.13%。

周一人民币兑美元中间价报 6.4819，较上个交易日下调 202 点。在岸、离岸人民币兑美元开盘后双双快速走强，午后维持震荡。截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4763，较上个交易日官方收盘价升值 14 点。离岸人民币兑美元现报 6.4880，较上个交易日收盘价升值 94 点，目前两岸汇差在 117 点附近。美元指数震荡走低，现报 90.1400，较上个交易日下跌 0.08%。

上周五（1 月 22 日）CFETS 人民币汇率指数录得 95.99，按周上涨 0.01；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 99.95，按周上涨 0.01；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.49，按周下跌 0.05。

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