



【2021-01-05】

今日央行开展了 100 亿元 7 天期逆回购操作，有 1400 亿元逆回购到期，逆回购资金净回笼 1300 亿元。Shibor 利率全数下行，其中隔夜品种报 0.7290%，较上个交易日下跌 17.00 个基点；7 天品种报 1.8220%，较上个交易日下跌 17.10 个基点；1 个月品种报 2.5770%，较上个交易日下跌 6.50 个基点；3 个月品种报 2.7340%，较上个交易日下跌 1.20 个基点。今日资金面呈宽松态势，早盘国股大行少量融出，午后资金面维持宽松直至收盘。

今日早间发行的 3 年期、5 年期、7 年期和 20 年期国开行固息债中标利率分别为 2.98%、3.2085%、3.4000%、3.8683%，全场倍数分别为 5.74 倍、5.09 倍、9.41 倍、9.41 倍，边际倍数分别为 1.26 倍、2.08 倍、38.50 倍、1.01 倍，午后发行的 2 年期、7 年期农发行上清所托管固息增发债中标利率分别为 2.7999%、3.4244%，全场倍数分别为 6.85 倍、2.80 倍，边际倍数分别为 23.25 倍、1.61 倍，国债期货早盘走低，随后持续震荡上行，10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 98.070，较上个交易日上涨 0.25%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.880，较上个交易日上涨 0.15%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.425，较上个交易日上涨 0.08%。今日现券收益率下行。截至目前，剩余期限 9.79 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.5275%/3.525%，剩余期限 9.87 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.1425%/3.1314%。

周二人民币兑美元中间报价 6.4760，较上个交易日上调 648 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘双双大幅上行，随后冲高回落，午后持续震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4640，较上个交易日官方收盘价贬值 12 点。离岸人民币兑美元现报 6.4485，较上个交易日收盘价升值 65 点，目前两岸汇差倒挂在 155 点附近。美元指数震荡下行，现报 89.73，较上个交易日下跌 0.16%。

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