

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

【2022-01-04】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 2700 亿逆回购到期，当日资金净回笼 2600 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.9250%，下跌 20.40 个基点；7 天品种报 2.0990%，下跌 17.20 个基点；1 个月品种报 2.4290%，下跌 0.20 个基点；3 个月品种报 2.5000%，与前一交易日持平。今日资金面早盘均衡，后逐渐转为宽松，国股大行有持续融出。

今日上午发行的 1 年期、3 年期、5 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.0976%、2.4850%、2.6979%，全场倍数分别为 3.33 倍、3.88 倍、4.25 倍，边际倍数分别为 1.68 倍、1.46 倍、1.01 倍。今日国债期货上午低开低走低位震荡，下午震荡上行，跌幅收窄。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.750，较上个交易日下跌 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.715，与上个交易日持平；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.085，与上个交易日基本持平。今日现券收益率上午高开后震荡，午后小幅下行。截至目前，剩余期限 9.69 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.08%/3.08%，剩余期限 9.87 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.7875%/2.775%。

周二美元兑人民币中间价报 6.3794，较上个交易日上调 37 点。今日在岸、离岸美元兑人民币上午小幅震荡下行，午后快速反弹转涨后震荡下行，涨幅收窄，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3745，较上一交易日升值 15 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.3781，较上一交易日升值 31 个基点，目前两岸汇差在 36 个基点附近。美元指数震荡，现报 96.25，较上个交易日上涨 0.03%。

上周最后一个交易日（12 月 31 日）CFETS 人民币汇率指数录得 102.47，按周上涨 0.04；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 106.66，按周下跌 0.02；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 100.34，按周下跌 0.12。

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