

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

【2021-02-01】

今日央行公开市场进行 1000 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，资金净投放 980 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.7950%，下跌 48.70 个基点；7 天品种报 3.1940%，上涨 12.30 个基点；1 个月品种报 2.8500%，上涨 1.80 个基点；3 个月品种报 2.7730%，上涨 0.80 个基点。今日资金面早盘延续上周紧张状态，早盘大行国股无资金融出，隔夜至 14 天期资金供给较少；午盘后资金面开始转松，大行国股有部分融出，各期限报价较上午下降。

今日财新公布了中国制造业 PMI 数据，数据显示 2021 年 1 月制造业 PMI 为 51.5，连续第九个月位于扩张区间，前值为 53。

今日午后发行的发行的 3 年期[200407Z17.IB]、5 年期[200408Z10.IB]农发行金融债券中标利率分别为 3.1208%、3.3222%，全场倍数分别为 3.93 倍、4.36 倍，边际倍数为 5.06 倍、28.2 倍。国债期货早盘高开，后全天高位震荡，尾盘收红。10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 97.805，较上个交易日上涨 0.13%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.680，较上个交易日上涨 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.320，较上个交易日上涨 0.08%。今日现券收益率全天震荡，小幅下行。截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.58%/3.58%，剩余期限 9.80 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.17%/3.17%。

周一人民币兑美元中间价报 6.4623，较上个交易日上调 86 点。在岸、离岸人民币兑美元高开后快速下行，后在前收盘价附近宽幅震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4641，较上一交易日跌 29 个基点；离岸人民币兑美元现报 6.4687，较上个交易日收盘价升值 198 点，目前两岸汇差在 46 点附近。美元指数全天震荡，尾盘快速拉升，现报 90.73，较上个交易日上涨 0.22%。

上周最后一个交易日（1 月 29 日）CFETS 人民币汇率指数录得 96.50，按周上涨 0.51；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 100.39，按周上涨 0.44；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.55，按周下跌 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