

# 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

【2021-04-15】

今日央行开展 1500 亿元中期借贷便利 (MLF) 操作 (含对 4 月 15 日 MLF 到期和 4 月 25 日 TMLF 到期的续做) 和 100 亿元逆回购操作, 有 100 亿逆回购及 1000 亿 MLF 到期, 当日资金净投放 500 亿。Shibor 利率大部分下行, 其中隔夜品种报 1.8100%, 与昨日持平; 7 天品种报 2.0580%, 下跌 0.50 个基点; 1 个月品种报 2.5020%, 下跌 0.10 个基点; 3 个月品种报 2.6020%, 下跌 0.10 个基点。今日上午资金面均衡, 大行国股有部分融出, 午后边际趋紧。

今日上午发行的 91 天期进出口行贴现债、3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.9022%、3.0893%、3.2756%、3.5528%, 全场倍数分别为 4.79 倍、4.02 倍、3.38 倍、2.65 倍, 边际倍数分别为 4.36 倍、1.17 倍、1.00 倍、1.00 倍。下午发行的 91 天期国开行贴现债、1 年期、2 年期、3 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.0075%、2.4800%、2.8344%、3.0655%、3.4855%, 全场倍数分别为 8.51 倍、5.44 倍、9.69 倍、6.72 倍、4.16 倍, 边际倍数分别为 1.80 倍、1.09 倍、5.41 倍、3.81 倍、1.03 倍。国债期货全天震荡下行, 10 年期国债期货主力合约 T2106 收报 97.700, 较上个交易日下跌 0.09%; 5 年期国债期货主力合约 TF2106 收报 99.760, 较上个交易日下跌 0.05%; 2 年期国债期货主力合约 TS2106 收报 100.260, 较上个交易日下跌 0.02%。今日现券收益率小幅上行。截至目前, 剩余期限 9.52 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.5925%/3.5925%, 剩余期限 9.60 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.1675%/3.1665%。

周四美元兑人民币中间价报 6.5297, 较上个交易日下调 65 点。今日在岸、离岸美元兑人民币上午震荡上行, 下午震荡回落转跌。截至 16:30, 在岸美元兑人民币收报 6.5322, 较上一交易日贬值 12 个基点; 离岸美元兑人民币现报 6.5351, 较上一交易日升值 31 个基点, 目前两岸汇差在 29 点附近。美元指数上午低位反弹, 随后震荡, 下午三点后回落转跌, 现报 91.63, 较上个交易日下跌 0.02%。

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**