



【2023-01-06】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 3860 亿逆回购到期，当日资金净回笼 3840 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 0.5390%，下跌 3.50 个基点；7 天品种报 1.5800%，上涨 19.20 个基点；1 个月品种报 2.1500%，下跌 3.90 个基点；3 个月品种报 2.3350%，下跌 1.70 个基点。今日资金面早盘均衡偏松，后边际收敛，资金价格整体回升。

今日上午发行的 90 天期进出口行贴现债、1 年期、3 年期、5 年期[200305Z26.IB]、5 年期[220315Z26.IB]、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.6042%、2.1025%、2.454%、2.6039%、2.7889%、3.0185%，全场倍数分别为 3.14 倍、1.94 倍、3.76 倍、1.89 倍、2.39 倍、2.22 倍，边际倍数分别为 1.20 倍、2.83 倍、40.10 倍、9.89 倍、1.38 倍、1.52 倍。今日国债期货早盘低开，后震荡下行，尾盘有所回升，跌幅略有收窄。10 年期国债期货主力合约 T2303 收报 101.350，较上个交易日下跌 0.08%；5 年期国债期货主力合约 TF2303 收报 101.060，较上个交易日下跌 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2303 收报 100.890，较上个交易日下跌 0.05%。今日现券成交活跃，主要现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.81 年的国开债活跃券 220220 收益率报 2.9552/2.95，剩余期限 9.87 年的国债活跃券 220025 收益率报 2.8345%/2.8305%。

周五美元兑人民币中间价报 6.8912，较上个交易日下调 14 点。今日在岸、离岸美元兑人民币上午大幅跳水转跌，午后震荡回升，跌幅有所收窄，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.8588，较上一交易日下跌 143 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.8663，较上一交易日下跌 227 个基点，目前两岸汇差在 75 个基点附近。美元指数上午窄幅震荡，午后震荡上行，现报 105.32，较上一交易日上涨 0.18%。

以上仅供参考，谢谢！

文/JasonMao

如果您对本文有任何评论与见解
请发电邮至: SHOffice@cfets-nex.com.cn

[扫描二维码 轻松查看更多资讯](#)



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