

# 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

【2021-01-29】

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 利率全线上涨，其中隔夜品种报 3.2820%，上涨 25.80 个基点；7 天品种报 3.0710%，上涨 9.00 个基点；1 个月品种报 2.8320%，上涨 12.40 个基点；3 个月品种报 2.7650%，上涨 6.00 个基点。今日资金面延续昨日紧张状态，午盘前大行国股无资金融出，隔夜期限至 14 天期限资金供给较少，价格抬升；尾盘大行开始融出隔夜资金，资金面偏紧的情况有所缓解。

今日早盘发行的 181 天期[2103664.IB]进出口行贴现金融债、1 年期[210314Z7.IB]、2 年期[210302Z3.IB]、7 年期[210307Z3.IB]进出口行增发金融债券中标利率分别为 2.5009%、2.6422%、3.0437%、3.453%，全场倍数分别为 5.77 倍、3.47 倍、3.92 倍、3.99 倍，边际倍数为 10 倍、1.11 倍、1.38 倍、1 倍。稍后发行的 91 天期[219905.IB]记账式贴现国债中标利率为 2.6657%，边际利率为 2.7218%，全场倍数分别为 4.68 倍，边际倍数为 1.42 倍。国债期货早盘低开震荡，午后由于市场传言出现大幅跳水，经辟谣后反弹修复，最终收红。10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 97.745，较上个交易日上涨 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.585，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.255，较上个交易日基本持平。今日现券收益率震荡下行，盘中受消息影响出现剧烈波动。截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.5925%/3.59%，剩余期限 9.80 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.18%/3.178%。

周五人民币兑美元中间价报 6.4709，较上个交易日上调 136 点。在岸人民币兑美元高位震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4612，较上一交易日涨 146 个基点。离岸人民币全天宽幅震荡，离岸人民币兑美元现报 6.4743，较上个交易日收盘价升值 9 点，目前两岸汇差在 131 点附近。美元指数震荡走高，现报 90.74，较上个交易日上涨 0.22%。

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**