



【2023-01-11】

今日央行开展 650 亿 7 天期、220 亿 14 天期逆回购操作，有 160 亿逆回购到期，当日资金净投放 710 亿。Shibor 利率整体上行，短端幅度更大，其中隔夜品种报 1.4260%，上涨 31.00 个基点；7 天品种报 1.9960%，上涨 6.30 个基点；1 个月品种报 2.1740%，上涨 3.60 个基点；3 个月品种报 2.3470%，上涨 0.90 个基点。今日资金面早盘偏紧，后随着机构逐渐融出，资金面逐渐转松，资金价格仍有所上行。

今日上午发行的 28 天期、63 天期贴现国债、3 年期、7 年期附息续发国债中标利率分别为 1.3637%、1.5796%、2.4687%、2.8253%，边际利率分别为 1.5008%、1.7025%、2.5091%、2.8628%，全场倍数分别为 3.98 倍、3.73 倍、2.79 倍、3.03 倍，边际倍数分别为 1.11 倍、3.49 倍、2.10 倍、2.51 倍。下午发行的 181 天期农发行贴现债、1 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 1.8827%、2.2067%、3.0556%，全场倍数分别为 4.83 倍、2.19 倍、2.01 倍、边际倍数分别为 1.00 倍、1.00 倍、1.00 倍。今日国债期货早盘低开，后震荡回升，最终全线收涨。10 年期国债期货主力合约 T2303 收报 100.180，上涨 0.06%；5 年期国债期货主力合约 TF2303 收报 100.915，较上个交易日上涨 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2303 收报 100.835，较上个交易日上涨 0.02%。今日现券成交活跃，主要现券收益

率上午震荡，午后明显下行，截至目前，剩余期限 9.79 年的国开债活跃券 220220 收益率报 2.985/2.983，剩余期限 9.86 年的国债活跃券 220025 收益率报 2.8675%/2.86%。

周二美元兑人民币中间价报 6.7756，较上个交易日上调 145 点。今日在岸美元兑人民币早盘高开后震荡回落，转跌，午后反弹，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7775，较上一交易日上涨 3 个基点；离岸美元兑人民币上午冲高回落后转跌，午后反弹，现报 6.7857，较上一交易日上涨 11 个基点，目前两岸汇差在 82 个基点附近。美元指数冲高回落后反弹，总体震荡，现报 103.32，较上一交易日上涨 0.03%。

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