



【2023-01-13】

今日央行开展 550 亿 7 天期、770 亿 14 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金净投放 1300 亿。Shibor 利率短端下行，其中隔夜品种报 1.2420%，下跌 22.30 个基点；7 天品种报 1.9400%，下跌 5.20 个基点；1 个月品种报 2.2200%，上涨 2.60 个基点；3 个月品种报 2.3530%，与上个交易日持平。今日资金面上午均衡，午后机构融出减少，资金面明显转紧，隔夜资金加权价格较昨日有所回落。

今日海关总署公布了 2022 年 12 月进出口数据，数据显示，以人民币计价，12 月出口同比降 0.5%，前值增 0.9%；进口增 2.2%，前值降 1.1%；贸易顺差 5501.1 亿元，前值 4943.3 亿元。以美元计价，12 月出口同比降 9.9%，预期降 10.4%，前值修正为降 8.9%；进口降 7.5%，预期降 8.6%，前值降 10.6%；贸易顺差 780.1 亿美元。

今日上午发行的 91 天期、182 天期贴现国债、1 年期、5 年期付息国债中标利率分别为 1.6812%、1.9102%、2.0100%、2.6400%，边际利率分别为 1.7564%、1.9644%、2.0700%、2.6700%，全场倍数分别为 3.04 倍、3.68 倍、2.62 倍、2.79 倍，边际倍数分别为 42.67 倍、1.05 倍、1.05 倍、2.16 倍。稍后发行的 1 年期、2 年期、7 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.1512%、2.5322%、2.9280%，全场倍数分别为 2.35 倍、4.56 倍、3.39

倍，边际倍数分别为 1.02 倍、6.83 倍、1.43 倍。今日国债期货早盘震荡走低，午后小幅冲高后再度回落，跌幅扩大。10 年期国债期货主力合约 T2303 收报 100.025，下跌 0.20%；5 年期国债期货主力合约 TF2303 收报 100.900，较上个交易日下跌 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS2303 收报 100.845，下跌 0.03%。今日现券成交活跃，主要现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.79 年的国开债活跃券 220220 收益率报 3.025/3.0225，剩余期限 9.85 年的国债活跃券 220025 收益率报 2.9%/2.895%。

周五美元兑人民币中间价报 6.7292，较上个交易日下调 388 点。今日在岸美元兑人民币大幅低开后震荡回升，午后在再度下行，跌幅扩大，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7099，较上一交易日下跌 466 个基点；离岸美元兑人民币冲高回落，现报 6.7225，较上一交易日下跌 39 个基点，目前两岸汇差在 126 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 102.10，较上一交易日下跌 0.15%。

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