

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

【2021-02-05】

今日央行公开市场进行 1000 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1000 亿，资金零回笼零投放。Shibor 利率大部上涨，其中隔夜品种报 1.9090%，下跌 16.60 个基点；7 天品种报 2.3380%，上涨 1.40 个基点；1 个月品种报 2.7530%，上涨 0.10 个基点；3 个月品种报 2.7790%，上涨 0.30 个基点。早盘资金面均衡，大行国股有部分融出。隔夜供给较充裕，跨春节资金供给相对较少；午盘后随着大行国股持续融出资金，资金面延续宽松。

今日上午发行的 1 年期[200314Z8.IB]、2 年期[210302Z4.IB]、7 年期[200307Z4.IB]进出口行增发固息金融债券中标利率分别为 2.6147%、3.0641%、3.4936%，全场倍数分别为 6.42 倍、4.68 倍、4.49 倍，边际倍数为 1 倍、1 倍、1 倍。稍后发行的 91 天期[219907.IB]、182 天期[219906.IB]贴现国债中标利率分别为 2.3753%、2.4860%，边际利率为 2.4292%，2.5900%，全场倍数分别为 3.54 倍、2.57 倍，边际倍数 1.11 倍、8.17 倍。国债期货冲高回落，尾盘基本收平。10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 97.235，较上个交易日上涨 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.325，较上个交易日上涨 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.190，较上个交易日上涨 0.02%。今日现券收益率全天小幅震荡下行。截至目前，剩余期限 9.70 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.6825%/3.68%，剩余期限 9.79 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.2175%/3.2125%。

周五人民币兑美元中间价报 6.4710，较上个交易日下调 105 点。在岸人民币兑美元早盘低开，并快速走低，随后低位震荡。截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4810，较上一交易日跌 181 个基点；离岸人民币兑美元早盘低开，并快速走低，午后震荡上行，现报 6.4780，较上个交易日收盘价贬值 49 点，目前两岸汇差倒挂在 30 点附近。美元指数全天震荡，尾盘快速下行，现报 91.41，较上个交易日下跌 0.16%。

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