

# 市场概述 每日市场动态

常规报告系列



【2023-01-09】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 430 亿逆回购到期，当日资金净回笼 410 亿。Shibor 利率短端上行，其中隔夜品种报 0.6710%，上涨 13.20 个基点；7 天品种报 1.7290%，上涨 14.90 个基点；1 个月品种报 2.1350%，下跌 1.50 个基点；3 个月品种报 2.3310%，下跌 0.40 个基点。今日资金面早盘均衡偏松，后逐渐收紧，尾盘呈现均衡偏紧的态势，资金价格短端明显回升。

今日下午发行的 3 年期[210409Z12.IB]、3 年期[220412Z3.IB]、5 年期农发行固息增发债中标利率为 2.6097%、2.6292%、2.809%，全场倍数分别为 2.3 倍、2.60 倍、2.36 倍，边际倍数分别为 1.04 倍、1.75 倍、9.63 倍。今日国债期货早盘高开后震荡，主力合约多数收涨。10 年期国债期货主力合约 T2303 收报 100.355，较上个交易日上涨 0.06%；5 年期国债期货主力合约 TF2303 收报 101.030，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2303 收报 100.865，较上个交易日下跌 0.01%。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 9.80 年的国开债活跃券 220220 收益率报 2.9575/2.955，剩余期限 9.86 年的国债活跃券 220025 收益率报 2.845%/2.834%。

周一美元兑人民币中间价报 6.8265，较上个交易日下调 647 点。今日在岸、离岸美元兑人民币大幅下行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7712，较上一交易日下跌 876 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.7804，较上一交易日下跌 484 个基点，目前两岸汇差在 92 个基点附近。美元指数大幅下行，现报 103.51，较上一交易日下跌 0.38%。

上周最后一个交易日（1 月 6 日）CFETS 人民币汇率指数录得 100.03，按周上涨 1.36；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 105.21，按周上涨 1.54；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.63，按周上涨 1.55。

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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)