【2024-01-23】

今日央行开展 4650 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 7600 亿，此外央行进行国库现金定存 2 个月期限 500 亿，3 个月期限 700 亿，全口径资金净回笼 1750 亿。Shibor 利率多数持平，其中隔夜品种报 1.7600%，上行 0.00 个基点；7 天品种报 1.8070%，下行 3.70 个基点；1 个月品种报 2.3000%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 2.4000%，上行 0.00 个基点。今日资金面整体维持均衡附近波动，尾盘均衡偏松，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 3 年期、5 年期国开债中标收益率分别为 2.3210%、2.3922%，全场倍数分别为 2.91 倍、3.61 倍，边际倍数分别为 5.20 倍、19.67 倍；下午发行的 2 年期、7 年期农发清发债中标收益率分别为 2.2628%、2.6249%，全场倍数分别为 2.87 倍、5.22 倍，边际倍数分别为 1.35 倍、3.80 倍。国债期货弱势震荡，主力合约多数收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2403 收报 103.560，较上个交易日下跌 0.14%；10 年期国债期货主力合约 T2403 收报 103.020，较上个交易日下跌 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF2403 收报 102.525，较上个交易日下跌 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS2403 收报 101.200，较上个交易日上涨 0.00%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.33 年的国开债活

跃券 230210 收益率报 2.6990%/2.6980%，剩余期限 9.59 年的国债活跃券 230018 收益率报 2.5475%/2.5441%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1117，较上个交易日上调 12 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡下行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1695，较上一交易日下跌 273 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.1713，较上一交易日下跌 223 个基点，目前两岸汇差在 20 个基点附近。美元指数弱势震荡，现报 103.11，较上一交易日下跌 0.23%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui

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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息
禁止处理涉密信息和内部敏感信息
禁止处理涉密信息和内部敏感信息