



【2023-01-12】

今日央行开展 650 亿 7 天期、520 亿 14 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金净投放 1150 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.4650%，上涨 3.90 个基点；7 天品种报 1.9920%，下跌 0.40 个基点；1 个月品种报 2.1940%，上涨 2.00 个基点；3 个月品种报 2.3530%，上涨 0.60 个基点。今日资金面早盘稍紧，后随着机构逐渐融出，资金面逐渐转松，资金价格在昨日基础上有所震荡。

今日国家统计局公布了 2022 年 12 月通胀数据，数据显示 12 月 CPI 同比上涨 1.8%，预期涨 1.9%，前值涨 1.6%；12 月 PPI 同比下降 0.7%，预期将 0.3%，前值降 1.3%。

今日上午发行的 7 年期国开行上清所托管固息增发债中标利率为 2.8979%，全场倍数为 4.98 倍，边际倍数为 1.12 倍。稍后发行的 90 天期进出口贴现债、2 年期进出口行固息债、3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.6042%、2.5000%、2.6033%、2.8256%、3.0617%，全场倍数分别为 3.92 倍、3.76 倍、3.99 倍、2.46 倍、2.29 倍，边际倍数分别为 1.35 倍、1.16 倍、3.13 倍、1.55 倍、3.43 倍。下午发行的 3 年期国开行固息债、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.8000%、2.9502%，全场倍数分别为 3.31 倍、2.42 倍，边际倍数分别为 1.34 倍、1.53 倍。今日国债期货小幅高开后震荡，尾盘有所回落。

10 年期国债期货主力合约 T2303 收报 100.190，上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2303 收报 100.970，较上个交易日上涨 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2303 收报 100.875，较上个交易日上涨 0.04%。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 3.0025/3.00，剩余期限 9.86 年的国债活跃券 220025 收益率报 2.8775%/2.875%。

周四美元兑人民币中间价报 6.7680，较上个交易日下调 76 点。今日在岸美元兑人民币低开低位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7565，较上一交易日下跌 210 个基点；离岸美元兑人民币早盘震荡回落，后快速反弹回升，总体震荡，现报 6.7655，较上一交易日下跌 11 个基点，目前两岸汇差在 90 个基点附近。美元指数震荡下行，午后反弹，跌幅收窄，现报 103.23，较上一交易日下跌 0.02%。

以上仅供参考，谢谢！

文/JasonMao

如果您对本文章有任何评论与见解
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