



【2022-01-13】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 100 亿逆回购到期，当日资金零投放零回笼。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.2180%，上涨 24.60 个基点；7 天品种报 2.2020%，上涨 10.40 个基点；1 个月品种报 2.4270%，较上一交易日下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 2.5000%，与前一交易日持平。今日资金面早盘均衡偏紧，国股大行未有融出；偏紧的态势持续至午后，随着接近尾盘国股大行开始融出，资金面转松。

今日上午发行的 88 天期进出口行贴现债、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 1.9042%、2.5114%、2.7636%、3.1239%，全场倍数分别为 3.68 倍、4.43 倍、3.58 倍、2.58 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、15.78 倍、1.09 倍、1.17 倍。下午发行的 3 年期国开行固息增发债、10 年期国开行固息债中标利率分别为 2.4350%、3.0000%，全场倍数分别为 4.79 倍、4.31 倍，边际倍数分别为 1.17 倍、1.93 倍。今日国债期货上午窄幅震荡，下午先冲高后回落，最终收盘价基本与昨日持平。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.630，与上个交易日基本持平；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.680，与上个交易日基本持平；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.060，较上个交易日下跌 0.01%。今日现券收益率上午小窄幅震荡，下午先快速下行，后震荡回升。截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.0825%/3.0805%，剩余期限 9.85 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.79%/2.788%。

周四美元兑人民币中间价报 6.3542，较上个交易日下调 116 点。今日在岸美元兑人民币上午低开后震荡上行，下午冲高回落，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3598，较上一交易日贬值 48 个基点；离岸美元兑人民币震荡上行，下午 15:00 后回落，涨幅收窄，现报 6.3642，较上一交易日升值 24 个基点，目前两岸汇差在 44 个基点附近。美元指数上午窄幅震荡，下午 15:00 后快速大幅下行，16:00 止跌反弹，现报 94.77，较上个交易日贬值 0.24%。

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