

# 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

【2020-10-23】

今日央行开展了 700 亿元逆回购操作，有 500 亿元逆回购到期，逆回购资金净投放 200 亿元。Shibor 利率全数上行，其中隔夜品种报 2.1610%，较上个交易日上涨 25.00 个基点；7 天品种报 2.2050%，较上个交易日上涨 1.50 个基点；1 个月品种报 2.6530%，较上个交易日上涨 0.40 个基点；3 个月品种报 2.8950%，较上个交易日上涨 1.80 个基点。今日资金面呈均衡态势，早盘 7 天以内期限融出较少，午后资金面持续收紧，尾盘有所放松直至收盘。

今日早间发行的 3 个月期、6 个月期贴现国债加权中标利率分别为 2.5568%、2.7006%，边际利率分别为 2.6242%、2.7548%，全场倍数分别为 3.06 倍、2.50 倍，边际倍数分别为 2.43 倍、1.42 倍；30 年期附息国债中标利率为 3.8815%，全场倍数为 2.63 倍，边际倍数为 4.91 倍，稍早发行的 3 年期、5 年期国开行 LPR 浮息债中标利率分别为 3.3124%、3.5259%，全场倍数分别为 3.93 倍、4.74 倍，边际倍数分别为 2.27 倍、3.85 倍，同时发行的 1 年期、2 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.7083%、3.0928%、3.4647%，全场倍数分别为 3.73 倍、4.62 倍、6.38 倍，边际倍数分别为 10.63 倍、2.68 倍、1.05 倍。国债期货全天震荡，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 97.965，较上个交易日下跌 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 99.850，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.285，较上个交易日下跌 0.03%。今日现券收益率小幅上行。截至目前，剩余期限 9.65 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.7475%/3.7475%，剩余期限 9.58 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.19%/3.1875%。

周五人民币兑美元中间报价 6.6703，较上个交易日下调 147 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘大幅走低，随后触底反弹，北京时间下午 2 点后直线拉升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.6690，较上个交易日官方收盘价贬值 1 点。离岸人民币兑美元现报 6.6540，较上个交易日收盘价升值 171 点，目前两岸汇差倒挂在 150 点附近。美元指数早盘冲高后持续震荡，北京时间下午 2 点后大幅走低，现报 92.76，较上个交易日下跌 0.19%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Neal Tao

如果您对本文有任何评论与见解  
请发电邮至：[SHResearch@cfets-nex.com.cn](mailto: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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)