



【2022-12-26】

今日央行开展 1730 亿 7 天期、430 亿 14 天期逆回购操作，有 90 亿逆回购到期，当日资金净投放 2070 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 0.8200%，上涨 23.50 个基点；7 天品种报 1.9610%，上涨 27.40 个基点；1 个月品种报 2.3060%，上涨 1.90 个基点；3 个月品种报 2.4050%，上涨 0.30 个基点。今日资面早盘均衡，后逐渐趋松，国股大行有部分融出，跨年资金价格明显上行。

今日国债期货早盘快速下行，后低位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2303 收报 100.270，较上个交易日下跌 0.16%；5 年期国债期货主力合约 TF2303 收报 101.015，较上个交易日下跌 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS2303 收报 100.875，较上个交易日下跌 0.01%。今日主要现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 220215 收益率报 3.005%/3.005%，剩余期限 9.90 年的国债活跃券 220025 收益率报 2.84%/2.8385%。

周一美元兑人民币中间价报 6.9825，较上个交易日上调 15 点。今日在岸、离岸美元兑人民币震荡下行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.9587，较上一交易日下跌 283 个基

点；离岸美元兑人民币现报 6.9780，较上一交易日下跌 229 个基点，目前两岸汇差在 193 个基点附近。美元指数低位窄幅震荡，现报 104.27，较上一交易日下跌 0.05%。

上周最后一个交易日（12 月 23 日）CFETS 人民币汇率指数录得 98.54，按周下跌 0.40；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 103.59，按周下跌 0.65；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.00，按周下跌 0.17。

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