

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

【2021-02-04】

今日央行公开市场进行 1000 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1000 亿，资金零回笼零投放。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.0750%，上涨 21.60 个基点；7 天品种报 2.3240%，上涨 17.80 个基点；1 个月品种报 2.7520%，下跌 2.00 个基点；3 个月品种报 2.7760%，与昨日持平。今日资金面早盘均衡，大行国股少量融出；午后随着大行国股融出增加，资金面进一步宽松。

今日上午发行的 89 天期[2103665.IB]进出口行贴现金融债券、3 年期[200313Z15.IB]、5 年期[200315Z14.IB]、10 年期[180310Z25.IB]、10 年期[200311Z8.IB] 进出口行增发固息金融债券中标利率分别为 2.007%、3.1949%、3.3706%、3.5258%、3.6842%，全场倍数分别为 5.21 倍、3.37 倍、3.19 倍、3.98 倍、3.17 倍，边际倍数 2.5 倍、1 倍、1 倍、1.94 倍、1 倍。下午发行的发行的 2 年期[210212.IB]、7 年期[210204Z4]、10 年期[200215Z13.IB]国开行固息金融债券中标利率分别为 3.0000%、3.4919%、3.6455%，全场倍数分别为 9.43 倍、6.53 倍、4.36 倍，边际倍数为 1.32 倍、15 倍、26.74 倍。国债期货早盘震荡，午后走低。10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 97.230，较上个交易日下跌 0.17%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.335，较上个交易日下跌 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.155，较上个交易日下跌 0.08%。今日现券收益率全天大幅震荡上行。截至目前，剩余期限 9.71 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.685%/3.6825%，剩余期限 9.79 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.2325%/3.23%。

周四人民币兑美元中间价报 6.4605，较上个交易日上调 64 点。在岸人民币兑美元早盘震荡，午后走低。截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4629，较上一交易日跌 42 个基点；离岸人民币早盘开始震荡走低，现报 6.4650，较上个交易日收盘价贬值 69 点，目前两岸汇差在 21 点附近。美元指数全天震荡上行，现报 91.40，较上个交易日上涨 0.32%。

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