市场概述
每日市场动态

常规报告系列

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2021-01-04】

今日央行开展了 200 亿元 7 天期逆回购操作，有 1600 亿元逆回购到期，逆回购资金净回笼 1400 亿元。Shibor 利率全数下行，其中隔夜品种报 0.8990%，较上个交易日下跌 19.40 个基点；7 天品种报 1.9930%，较上个交易日下跌 38.80 个基点；1 个月品种报 2.6420%，较上个交易日下跌 6.00 个基点；3 个月品种报 2.7460%，较上个交易日下跌 1.00 个基点。今日资金面呈宽松态势，午后资金面维持宽松直至收盘。

今日国债期货早盘小幅上行，随后持续震荡走低，10 年期国债期货主力合约 T2103 收报 97.840，较上个交易日下跌 0.13%；5 年期国债期货主力合约 TF2103 收报 99.755，较上个交易日下跌 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2103 收报 100.345，较上个交易日下跌 0.04%。今日现券收益率上行。截至目前，剩余期限 9.79 年的国开债活跃券 200215 收益率报 3.575%/3.57%，剩余期限 9.87 年的国债活跃券 200016 收益率报 3.18%/3.1775%。

周一人民币兑美元中间报价 6.5408，较上个交易日下调 159 点。在岸、离岸人民币兑美元双双大幅上行，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.4628，较上个交易日官方收盘价升值 770 点。离岸人民币兑美元现报 6.4449，较上个交易日收盘价升值 601 点，目前两岸汇差倒挂在 179 点附近。美元指数震荡下行，现报 89.57，较上个交易日下跌 0.40%。

上周最后一个交易日（12 月 31 日）CFETS 人民币汇率指数录得 94.84，按周下跌 0.37；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.68，按周下跌 0.39；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.23，按周下跌 0.28。

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

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。