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

【2022-02-15】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购及 3000 亿 1 年期 MLF 操作，有 200 亿逆回购到期，当日全口径资金净投放 2900 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.8070%，下跌 5.90 个基点；7 天品种报 2.0000%，下跌 2.30 个基点；1 个月品种报 2.3480%，下跌 1.10 个基点；3 个月品种报 2.4150%，下跌 0.90 个基点。今日资金面整体均衡偏松，国股大行有持续融出。

今日上午发行的 1 年期、3 年期、5 年期国开行固息增发债中标利率分别为 1.7611%、2.3427%、2.5648%，全场倍数分别为 2.83 倍、4.65 倍、5.51 倍，边际倍数分别为 1.72 倍、1.46 倍、2.05 倍。下午发行的 2 年期、7 年期农发行上清所托管固息债中标利率分别为 2.2700%、2.9100%，全场倍数分别为 3.27 倍、4.23 倍，边际倍数分别为 2.80 倍、1.02 倍。今日国债期货震荡走高，尾盘回落。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.530，较上个交易日下跌 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.855，较上个交易日下跌 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.215，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率震荡下行，午后反弹回升，截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.07%/3.068%，剩余期限 9.76 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.795%/2.794%。

周二美元兑人民币中间价报 6.3605，较上个交易日下调 59 点。今日在岸美元兑人民币低开后震荡，午后进一步下行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3475，较上一交易日贬值 123 个基点；离岸美元兑人民币震荡下行，现报 6.3502，较上一交易日贬值 68 个基点，目前两岸汇差在 27 个基点附近。美元指数震荡下行，下午 16:00 跌幅进一步扩大，现报 96.08，较上个交易日贬值 0.21%。

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。