



【2022-02-17】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 200 亿逆回购到期，当日资金净回笼 100 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.8550%，下跌 8.70 个基点；7 天品种报 2.0020%，下跌 5.50 个基点；1 个月品种报 2.3340%，下跌 0.60 个基点；3 个月品种报 2.4060%，下跌 0.40 个基点。今日资金面早盘均衡，国股大行有部分融出；午后资金面逐渐趋紧，国股大行停止融出，并有部分回补，偏紧态势持续至收盘。

今日上午发行的 89 天期进出口行贴现债、3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.3372%、2.3854%、2.6571%、3.0830%，全场倍数分别为 5.43 倍、4.48 倍、3.87 倍、3.90 倍，边际倍数分别为 5.25 倍、1.17 倍、3.83 倍、1.47 倍。下午发行的 7 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.8887%、2.9392%，全场倍数分别为 5.76 倍、3.50 倍，边际倍数分别为 1.10 倍、4.60 倍。今日国债期货高开后高位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2206 收报 100.390，较上个交易日上涨 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2206 收报 101.670，较上个交易日上涨 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.220，较上个交易日上涨 0.02%。今日现券收益率小幅低开后震荡，截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.054%/3.05%，剩余期限 9.75 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.78%/2.7775%。

周四美元兑人民币中间价报 6.3321，较上个交易日下调 142 点。今日在岸美元兑人民币低开后震荡上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3366，较上一交易日升值 13 个基点；离岸美元兑人民币全天震荡，现报 6.3341，较上一交易日升值 15 个基点，目前两岸汇差倒挂在 25 个基点附近。美元指数早盘震荡，午间冲高，后回落，现报 95.83，基本与上个交易日持平。

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