



【2022-09-01】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金零回笼零投放。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.4630%，上涨 6.20 个基点；7 天品种报 1.4970%，下跌 28.30 个基点；1 个月品种报 1.5000%，下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 1.6000%，与前一交易日持平。今日资金面早盘均衡，但国股大行无融出，资金面逐渐趋紧，后随着融入需求陆续得到满足，尾盘趋于均衡，隔夜资金利率仍有所上行。

今日财新公布了中国 8 月财新制造业 PMI 数据，数据录得为 49.5，预期为 50.2，前值为 50.4。

今日上午发行的 91 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 1.1867%、2.2861%、2.5593%、2.9246%，全场倍数分别为 4.17 倍、5.29 倍、4.52 倍、4.07 倍，边际倍数分别为 2.77 倍、1.02 倍、8.36 倍、3.50 倍。下午发行的 3 年期、7 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.0828%、2.7193%、2.7160%，全场倍数分别为 4.93 倍、8.96 倍、4.11 倍，边际倍数分别为 2.62 倍、3.75 倍、1.75 倍。今日国债期货上午窄幅震荡，下午震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.685，

较上个交易日上涨 0.23%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 102.035，较上个交易日上涨 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.240，较上个交易日上涨 0.05%。今日主要现券收益率上午窄幅震荡，午后震荡下行，截至目前，剩余期限 9.65 年的国开债活跃券 220210 收益率报 2.8675%/2.863%，剩余期限 9.71 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.6275%/2.6275%。

周四美元兑人民币中间价报 6.8821，较上个交易日下调 85 点。今日在岸美元兑人民币高开后高位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.8990，较上一交易日上涨 85 个基点；离岸美元兑人民币冲高回落，下午 16:00 后迅速跳水，现报 6.9046，较上一交易日下跌 23 个基点，目前两岸汇差在 56 个基点附近。美元指数上午大幅上行，下午触顶震荡回落，现报 108.91，较上一交易日上涨 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