



【2022-07-29】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 30 亿逆回购到期，当日资金净回笼 10 亿。Shibor 利率短端反弹，其余期限多数下行，其中隔夜品种报 1.2540%，上涨 24.00 个基点；7 天品种报 1.7050%，上涨 15.90 个基点；1 个月品种报 1.7370%，下跌 0.50 个基点；3 个月品种报 1.8460%，下跌 0.80 个基点。今日资金面上午均衡，午后有转松，国股大行有部分融出，资金利率有所回升。

今日上午发行的 2 年期农发行绿色固息增发债中标利率为 1.7136%，全场倍数为 5.28 倍，边际倍数为 1.67 倍。稍后发行的 1 年期进出口行固息债、2 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.6900%、2.1902%，全场倍数为 3.89 倍、5.76 倍，边际倍数分别为 23.50 倍、1.00 倍。下午发行的 91 天期、182 天期贴现国债中标利率分别为 1.3664%、1.5772%，边际利率分别为 1.4007%、1.6275%，全场倍数分别为 3.02 倍、2.59 倍，边际倍数分别为 4.96 倍、1.04 倍。今日国债期货上午高开后继续震荡走高，下午高位窄幅震荡。10 年期国债期货主力合约 T2209 收报 101.050，较上个交易日上涨 0.36%；5 年期国债期货主力合约 TF2209 收报 101.800，较上个交易日上涨 0.22%；2 年期国债期货主力合约 TS2209 收报 101.225，

较上个交易日上涨 0.11%。今日主要现券收益率上午震荡下行，午后进一步走低，后触底小幅回升，截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 220210 收益率报 3.01%/3.01%，剩余期限 9.80 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.755%/2.755%。

周五美元兑人民币中间价报 6.7437，较上个交易日上调 26 点。今日在岸美元兑人民币早盘小幅冲高后震荡回落，午后跌幅扩大，后触底小幅回升，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7390，较上一交易日贬值 60 个基点；离岸美元兑人民币上午冲高回落，午后冲高触顶后大幅回落转跌，下午 16:00 后止跌小幅反弹，现报 6.7392，较上一交易日贬值 38 个基点，目前两岸汇差在 2 个基点附近。美元指数上午震荡，午后大幅下行，下午 15:00 左右触底反弹，现报 105.92，较上一交易日下跌 0.23%。

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