



【2022-08-16】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购、6000 亿 MLF 到期，当日全口径资金净回笼 6000 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.0750%，上涨 3.20 个基点；7 天品种报 1.3920%，下跌 3.30 个基点；1 个月品种报 1.5000%，下跌 0.50 个基点；3 个月品种报 1.5990%，下跌 0.80 个基点。今日资金面早盘均衡，国股大行融出偏少，午后资金面明显收紧，后有部分大行有少量融出，尾盘资金面略有转松，资金利率有所反弹。

今日上午发行的 1 年期、3 年期、5 年期、7 年期国开行固息增发债中标利率分别为 1.5555%、2.1573%、2.3664%、2.7366%，全场倍数分别为 3.97 倍、6.41 倍、4.44 倍、5.88 倍，边际倍数分别为 1.58 倍、80.67 倍、1.13 倍、9.44 倍。下午发行的 2 年期、7 年期农发行上清所托管固息增发债中标利率分别为 2.0858%、2.7652%，全场倍数分别为 4.54 倍、4.28 倍，边际倍数分别为 5.50 倍、6.60 倍。今日国债期货高开后小幅回落，探底回升，午后冲高回落，总体高位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2209 收报 101.985，较上个交易日上涨 0.08%；5 年期国债期货主力合约 TF2209 收报 102.400，较上个交易日上涨 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2209 收报 101.435，与上个交易日持平。今日主要现券收益率早盘大

幅下行，后触底回升，低位震荡，截至目前，剩余期限 9.69 年的国开债活跃券 220210 收益率报 2.8825%/2.8825%，剩余期限 9.75 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.6325%/2.63%。

周二美元兑人民币中间价报 6.7730，较上个交易日上调 320 点。今日在岸美元兑人民币高开后震荡回落，触底后震荡回升，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7919，较上一交易日上涨 287 个基点；离岸美元兑人民币上午大幅下行，午后触底反弹，现报 6.8085，较上一交易日下跌 78 个基点，目前两岸汇差在 176 个基点附近。美元指数上午窄幅震荡，下午 15:00 后快速上行。冲高回落，宽幅震荡，现报 106.69，较上一交易日上涨 0.17%。

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