



【2020-07-22】

今日央行未开展逆回购操作，无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率短端下跌，长端上涨，其中隔夜品种报 1.3360%，较上个交易日下跌 24.80 个基点；7 天品种报 2.0080%，较上个交易日下跌 9.30 个基点；1 个月品种报 2.2250%，较上个交易日上涨 0.20 个基点；3 个月品种报 2.5010%，较上个交易日上涨 3.50 个基点。今日早盘资金面宽松，各类机构均有隔夜期限融出，临近午盘资金面快速趋紧，收盘前市场再次转向宽松。

今日早间发行的国开行上交所 5 年期固息新发债中标利率为 3.0200%，全场倍数为 8.03 倍，边际倍数为 6.25 倍；5 年期国开行固息增发债中标收益率为 2.7575%，全场倍数为 5.70 倍，边际倍数为 2.18 倍，午后发行的 1 年期、10 年期（160405Z19.IB）、10 年期（170415Z28.IB）、10 年期（200404Z14.IB）农发行固息增发债中标利率分别为 2.4455%、3.3008%、3.3788%、3.5819%，全场倍数分别为 3.61 倍、6.08 倍、9.18 倍、4.29 倍，边际倍数分别为 2.47 倍、4.85 倍、1.05 倍、2.07 倍。国债期货早盘低位震荡，午盘起大幅拉升。10 年期国债期货主力合约 T2009 收报 99.770，较上个交易日上涨 0.43%，5 年

期国债期货主力合约 TF2009 收报 101.325 ,较上个交易日上涨 0.26% ;2 年期国债期货主力合约 TS2009 收报 100.970 ,较上个交易日上涨 0.07%。今日现券收益率先上后下。截至目前 ,剩余期限 9.63 年的国开债活跃券 200205 收益率报 2.89%/2.87% ,剩余期限 9.83 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.4075%/3.3800%。

周三人民币兑美元中间报价 6.9718 ,较上个交易日上调 144 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘震荡 ,双双在北京时间下午 3 点后跳水 ,跌破 7 关口 ,截至 16:30 ,在岸人民币兑美元收报 7.0059 ,较上个交易日官方收盘价下跌 123 点。离岸人民币兑美元现报 7.0055 ,较上个交易日收盘价下跌 320 点 ,目前两岸汇差倒挂在 4 点附近。美元指数全天震荡 ,午后大幅拉升 ,现报 95.34 ,较上个交易日上涨 0.17%。

以上仅供参考 ,谢谢 !

文/Julia Ji

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