



【2022-08-15】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购、4000 亿一年期 MLF 操作，操作利率均下调 10BP，有 20 亿逆回购到期，当日全口径资金净投放 4000 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.0430%，下跌 0.10 个基点；7 天品种报 1.4250%，上涨 1.20 个基点；1 个月品种报 1.5050%，下跌 0.80 个基点；3 个月品种报 1.6070%，下跌 1.50 个基点。今日资金面均衡偏松，国股大行有部分融出，资金利率低位震荡。

今日国家统计局公布了 2022 年 7 月经济数据，数据显示，中国 7 月规模以上工业增加值同比增 3.8%，预期增 4.6%，前值增 3.9%；中国 7 月社会消费品零售总额同比增长 2.7%，预期增长 5.3%，前值增长 3.1%；中国 1-7 月全国固定资产投资同比增长 5.7%，预期增长 6.2%，前值增长 6.1%。

今日下午发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.3200%、2.5485%，全场倍数分别为 4.87 倍、6.12 倍，边际倍数分别为 3.45 倍、5.71 倍。今日国债期货大幅高开并进一步冲高，后高位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2209 收报 101.940，较上个交易日上涨 0.70%；5 年期国债期货主力合约 TF2209 收报 102.430，较上个交易日上涨 0.52%；

2 年期国债期货主力合约 TS2209 收报 101.460，较上个交易日上涨 0.19%。今日主要现券收益率在早盘降息消息公布后，大幅下行，后低位震荡，下午有进一步下行，截至目前，剩余期限 9.69 年的国开债活跃券 220210 收益率报 2.905%/2.903%，剩余期限 9.76 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.6575%/2.656%。

周一美元兑人民币中间价报 6.7410，较上个交易日下调 3 点。今日在岸美元兑人民币高开震荡上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7632，较上一交易日上涨 283 个基点；离岸美元兑人民币早盘快速大幅上行，后持续震荡上行，现报 6.7747，较上一交易日上涨 365 个基点，目前两岸汇差在 115 个基点附近。美元指数上午冲高回落，下午大幅上行，现报 105.97，较上一交易日上涨 0.27%。

上周最后一个交易日（8 月 12 日）CFETS 人民币汇率指数录得 101.88，按周下跌 0.50；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 107.21，按周下跌 0.42；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 100.29，按周下跌 0.25。

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