

市场概述 每日市场动态

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2020-09-22】

今日央行开展了 2000 亿元 7 天期和 1500 亿元 14 天期逆回购操作，无逆回购到期，逆回购资金净投放 3500 亿元。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.2860%，较上个交易日上涨 8.20 个基点；7 天品种报 2.3320%，较上个交易日上涨 7.00 个基点；1 个月品种报 2.6240%，较上个交易日上涨 0.50 个基点；3 个月品种报 2.6700%，较上个交易日下跌 0.30 个基点。今日资金面开盘延续昨日紧张态势，央行公开市场操作之后逐渐转松，国股大行开始融出隔夜期限，午后资金面持续宽松至收盘。

今日早间发行的 3 年期、5 年期、7 年期、20 年期国开行固息增发债中标利率分别为 3.1774%、3.3515%、3.5882%、3.9609%，全场倍数分别为 3.40 倍、3.88 倍、5.99 倍、6.20 倍，边际倍数分别为 2.59 倍、4.50 倍、1.27 倍、1.01 倍，午后发行的 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 3.1022%、3.6659%，全场倍数分别为 8.85 倍、5.29 倍，边际倍数分别为 1.74 倍、1.62 倍，国债期货全天震荡上行，10 年期国债期货主力合约 T2012 收报 98.545，较上个交易日上涨 0.35%；5 年期国债期货主力合约 TF2012 收报 100.320，较上个交易日上涨 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS2012 收报 100.475，较上个交易日持平。今日现券收益率早盘上行，午后小幅下行。截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 200210 收益率报 3.645%/3.6425%，剩余期限 9.66 年的国债活跃券 200006 收益率报 3.085%/3.0825%。

周二人民币兑美元中间报价 6.7872，较上个交易日下调 277 点。在岸、离岸人民币兑美元全天震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7875，较上个交易日官方收盘价下跌 142 点。离岸人民币兑美元现报 6.7919，较上个交易日收盘价上涨 13 点，目前两岸汇差在 44 点附近。美元指数早盘震荡，午后快速上行，随后小幅回落，现报 93.65，较上个交易日上涨 0.16%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Neal Tao

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 轻松查看晨报及更多资讯



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