



【2022-09-15】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，此外央行还进行了 4000 亿 1 年期 MLF 操作，缩量平价对冲今日到期的 6000 亿 MLF，当日全口径资金净回笼 2000 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.2260%，上涨 5.30 个基点；7 天品种报 1.5470%，下跌 1.00 个基点；1 个月品种报 1.5080%，与前一交易日持平；3 个月品种报 1.5990%，与前一交易日持平。今日资金面早盘均衡稍紧，国股大行有部分融出，午后整体均衡，隔夜资金利率有所反弹。

今日上午发行的 91 天期进出口行贴现债、3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.1262%、2.2625%、2.5635%、2.9270%，全场倍数分别为 3.79 倍、4.36 倍、3.53 倍、2.98 倍，边际倍数分别为 1.53 倍、2.47 倍、2.10 倍、1.42 倍。下午发行的 3 年期、7 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.0443%、2.7251%、2.7468%，全场倍数分别为 5.58 倍、6.42 倍、3.45 倍，边际倍数分别为 3.24 倍、3.11 倍、1.36 倍。今日国债期货高开后震荡回落，后触底低位震荡，小幅收跌。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.270，较上个交易日下跌 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.750，

较上个交易日下跌 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.160，较上个交易日下跌 0.02%。今日主要现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.61 年的国开债活跃券 220210 收益率报 2.8675%/2.8675%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.6625%/2.6625%。

周四美元兑人民币中间价报 6.9101，较上个交易日下调 15 点。今日在岸、离岸美元兑人民币震荡上行，下午 16:00 后涨幅进一步扩大，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.9775，较上一交易日上涨 145 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.9872，较上一交易日上涨 142 个基点，目前两岸汇差在 97 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 109.73，较上一交易日上涨 0.07%。

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：SHOffice@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