

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

【2022-07-01】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 600 亿逆回购到期，当日资金净回笼 500 亿。Shibor 利率短端明显下行，其中隔夜品种报 1.4410%，下跌 46.00 个基点；7 天品种报 1.7980%，下跌 40.20 个基点；1 个月品种报 1.8870%，下跌 1.10 个基点；3 个月品种报 2.0000%，与前一交易日持平。今日资金整体均衡，国股大行有部分融出，尾盘有所转松，资金利率较昨日全线回落，且仍处于低位。

今日上午发行的 1 年期[210308Z9.IB]、1 年期[220304Z8.IB]、2 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.4512%、1.8669%、2.3520%，全场倍数分别为 5.97 倍、3.48 倍、4.06 倍，边际倍数分别为 1.81 倍、2.30 倍、6.42 倍。稍后发行的 91 天期国债贴现债中标利率为 1.5510%，边际利率 1.6917%，全场倍数为 2.28 倍，边际倍数为 1.13 倍。今日国债期货早盘低开后震荡上行，午后触顶震荡回落。10 年期国债期货主力合约 T2209 收报 99.955，较上个交易日下跌 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2209 收报 101.135，较上个交易日下跌 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2209 收报 100.960，较上个交易日上涨 0.01%。今日主要现券收益率窄幅震荡，下午有所上行，截至目前，剩余期限 9.82 年的国开债活跃券 220210 收益率报 3.0575%/3.0575%，剩余期限 9.88 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.8275%/2.8235%。

周五美元兑人民币中间价报 6.6863，较上个交易日下调 251 点。今日在岸、离岸美元兑人民币上午冲高，下午触顶回落，涨幅收窄，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7006，较上一交易日升值 63 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.7065，较上一交易日升值 127 个基点，目前两岸汇差在 59 个基点附近。美元指数震荡上行，午后振幅扩大，现报 104.96，较上一交易日上涨 0.24%。

周四美元兑人民币中间价报 6.7114，较上个交易日上调 79 点。今日在岸美元兑人民币上午高开后迅速回落，低位震荡，午后振幅扩大，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.6943，较上一交易日贬值 29 个基点；离岸美元兑人民币早盘小幅冲高回落后低位震荡，午后振幅扩大，现报 6.6995，较上一交易日贬值 84 个基点，目前两岸汇差在 52 个基点附近。美元指数早盘快速下行后低位震荡，午后触底反弹，低位宽幅震荡，现报 105.11，与前一交易日基本持平。

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