



【2022-08-18】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金零回笼零投放。Shibor 利率短端上行，其中隔夜品种报 1.1870%，上涨 4.90 个基点；7 天品种报 1.4790%，上涨 1.20 个基点；1 个月品种报 1.4910%，下跌 0.70 个基点；3 个月品种报 1.5980%，与前一交易日持平。今日资金面早盘均衡偏紧，随着有大行逐渐融出，资金面逐渐趋于平衡，资金利率仍有所反弹。

今日上午发行的 92 天期进出口行贴现债、3 年期、5 年期进出口行固息增发债、10 年期进出口行固息债中标利率分别为 1.1738%、2.2869%、2.5508%、2.9000%，全场倍数分别为 3.57 倍、4.60 倍、3.98 倍、4.11 倍，边际倍数分别为 4.35 倍、6.43 倍、320.00 倍、1.94 倍。下午发行的 3 年期、10 年期、20 年期国开行固息增发债中标利率分别为 1.9446%、2.7315%、3.1897%，全场倍数分别为 3.98 倍、3.80 倍、6.72 倍，边际倍数分别为 1.07 倍、3.79 倍、1.15 倍。今日国债期货高开后高位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2209 收报 102.115，较上个交易日上涨 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 102.060，较上个交易日上涨 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.230，较上个交易日上涨

0.05%。今日主要现券收益率小幅下行，截至目前，剩余期限 9.69 年的国开债活跃券 220210 收益率报 2.865%/2.863%，剩余期限 9.75 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.6175%/2.615%。

周四美元兑人民币中间价报 6.7802，较上个交易日下调 61 点。今日在岸美元兑人民币上午震荡上行，下午高位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7925，较上一交易日上涨 168 个基点；离岸美元兑人民币早盘小幅下行后触底反弹，下午进一步上行，后触顶小幅回落，现报 6.8054，较上一交易日上涨 135 个基点，目前两岸汇差在 129 个基点附近。美元指数早盘小幅下行后触底反弹，下午进一步上行，后触顶回落，现报 106.79，较上一交易日上涨 0.14%。

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