



【2022-07-20】

今日央行开展 30 亿 7 天期逆回购操作，有 30 亿逆回购到期，当日资金零投放零回笼。Shibor 利率短端上行，其中隔夜品种报 1.2700%，上涨 2.80 个基点；7 天品种报 1.6790%，上涨 5.00 个基点；1 个月品种报 1.7730%，上涨 0.30 个基点；3 个月品种报 1.9240%，下跌 2.40 个基点。今日资金面均衡，国股大行有部分融出，尾盘有所转松，资金利率仍处于低位。

今日中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布，7 月 1 年期贷款市场报价利率（LPR）为 3.7%，预期为 3.7%，上月为 3.7%；5 年期 LPR 为 4.45%，预期为 4.45%，上月为 4.45%。

今日上午发行的 3 年期进出口行上清所托管固息债中标利率为 2.2000%，全场倍数为 5.77 倍，边际倍数为 1.67 倍。稍后发行的 2 年期、10 年期续发付息国债中标利率分别为 2.1889%、2.7577%，边际利率分别为 2.2088%、2.7717%，全场倍数分别为 3.97 倍、4.36 倍，边际倍数分别为 2.93 倍、1.54 倍。下午发行的 1 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 1.8039%、3.0815%，全场倍数分别为 4.72 倍、4.92 倍，边际倍数分别为 15.74 倍、1.84 倍。今日国债期货上午震荡上行，午后小幅回落，尾盘大幅拉升。10 年期国债期货主力

合约 T2209 收报 100.735，较上个交易日上涨 0.19%；5 年期国债期货主力合约 TF2209 收报 101.585，较上个交易日上涨 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS2209 收报 101.095，较上个交易日上涨 0.04%。今日主要现券收益率窄幅震荡，下午 14:30 后迅速下行，截至目前，剩余期限 9.76 年的国开债活跃券 220210 收益率报 3.035%/3.035%，剩余期限 9.83 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.769%/2.768%。

周三美元兑人民币中间价报 6.7465，较上个交易日上调 14 点。今日在岸美元兑人民币上午震荡上行，午后触顶回落，下午 15:30 后触底反弹，宽幅震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7530，较上一交易日升值 92 个基点；离岸美元兑人民币早盘快速下行，后触底反弹，震荡上行，现报 6.7581，较上一交易日升值 125 个基点，目前两岸汇差在 51 个基点附近。美元指数上午震荡下行，午后快速反弹，后触顶回落，宽幅震荡，现报 106.65，较上一交易日下跌 0.06%。

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