



【2020-07-23】

今日央行开展了 500 亿元逆回购操作，有 500 亿元逆回购到期，逆回购资金零投放零回笼。Shibor 利率全数上涨，其中隔夜品种报 1.8580%，较上个交易日上涨 52.20 个基点；7 天品种报 2.2070%，较上个交易日上涨 19.90 个基点；1 个月品种报 2.2390%，较上个交易日上涨 1.40 个基点；3 个月品种报 2.5410%，较上个交易日上涨 4.00 个基点。今日早盘资金面受 TMLF 到期 2977 亿的影响呈均衡态势，午后大行股份制行相继开始大量融出隔夜期限，资金面维持宽松态势直至收盘。

今日早间发行的 10 年期 (130321Z.IB)、10 年期 (150314Z17.IB)、10 年期 (200310Z17.IB) 进出口行固息增发债中标利率分别为 2.9957%、3.2592%、3.6039%，全场倍数分别为 4.88 倍、7.05 倍、4.61 倍，边际倍数分别为 1.54 倍、24.33 倍、7.90 倍，随后发行的 10 年期续发抗疫特别国债加权中标利率为 2.7733%，边际利率为 2.8347%，全场倍数为 2.22 倍，边际倍数为 1.09 倍，午后发行的 1 年、5 年、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.4285%、3.1207%、3.3518%，全场倍数分别为 4.80 倍、7.17 倍、

3.23 倍，边际倍数分别为 1.09 倍、8.74 倍、1.29 倍。国债期货全天震荡，尾盘小幅收跌，10 年期国债期货主力合约 T2009 收报 99.655，较上个交易日下跌 0.02%，5 年期国债期货主力合约 TF2009 收报 101.200，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2009 收报 100.940，较上个交易日下跌 0.01%。受外围消息影响，今日现券收益率小幅上行。截至目前 剩余期限 9.63 年的国开债活跃券 200205 收益率报 3.4250%/3.4225%，剩余期限 9.83 年的国债活跃券 200006 收益率报 2.9050%/2.9000%。

周四人民币兑美元中间报价 6.9921，较上个交易日下调 203 点。在岸、离岸人民币兑美元双双震荡走高，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.9961，较上个交易日官方收盘价上涨 98 点。离岸人民币兑美元现报 6.9979，较上个交易日收盘价上涨 202 点，目前两岸汇差在 18 点附近。美元指数震荡下行，现报 94.88，较上个交易日下跌 0.10%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Julia Ji

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