



【2022-07-21】

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 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.2540%，下跌 1.60 个基点；7 天品种报 1.6790%，与前一交易日持平；1 个月品种报 1.7670%，下跌 0.60 个基点；3 个月品种报 1.9090%，下跌 1.50 个基点。今日资金面均衡偏松，国股大行有部分融出，资金利率小幅回落。

今日上午发行的 92 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 1.3535%、2.4837%、2.7377%、3.0776%，全场倍数分别为 3.72 倍、5.35 倍、4.08 倍、4.53 倍，边际倍数分别为 1.40 倍、11.65 倍、1.17 倍、43.61 倍。下午发行的 92 天期国开行贴现债、3 年期、10 年期国开行固息增发债中标利率分别为 1.2417%、2.1897%、2.9011%，全场倍数分别为 8.34 倍、5.37 倍、3.12 倍，边际倍数分别为 1.14 倍、3.43 倍、5.69 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 100.830，较上个交易日上涨 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2209 收报 101.660，较上个交易日上涨 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS2209 收报 101.110，较上个交易日上涨 0.04%。今日主要现券收益率早盘快速下行后震荡，午后小幅下行后触底小幅反弹，截至目前，

剩余期限 9.76 年的国开债活跃券 220210 收益率报 3.0275%/3.026%，剩余期限 9.82 年的国开债活跃券 220010 收益率报 2.764%/2.763%。

周四美元兑人民币中间价报 6.7620，较上个交易日上调 155 点。今日在岸美元兑人民币早盘高开并冲高，后触顶震荡回落，下午触底反弹，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7634，较上一交易日升值 104 个基点；离岸美元兑人民币上午震荡下行，下午触底反弹，震荡回升，现报 6.7743，较上一交易日贬值 10 个基点，目前两岸汇差在 109 个基点附近。美元指数上午震荡下行，下午触底反弹转升，现报 107.09，较上一交易日上涨 0.05%。

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