



【2022-07-28】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 30 亿逆回购到期，当日资金净回笼 10 亿。Shibor 利率除隔夜期限外，全线下行，其中隔夜品种报 1.0140%，上涨 0.60 个基点；7 天品种报 1.5460%，下跌 6.70 个基点；1 个月品种报 1.7420%，下跌 0.60 个基点；3 个月品种报 1.8540%，下跌 0.90 个基点。今日资金面均衡偏松，午后稍有波动，尾盘再度转松，国股大行有部分融出，隔夜资金利率在 1%附近波动。

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 1.2936%、2.4244%、2.7382%、3.0751%，全场倍数分别为 4.12 倍、4.73 倍、4.25 倍、4.51 倍，边际倍数分别为 2.81 倍、1.07 倍、4.25 倍、8.12 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 2.5252%、2.9169%、3.3119%，全场倍数分别为 5.88 倍、3.47 倍、5.15 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、1.28 倍、2.13 倍。今日国债期货上午小幅低开后震荡下行，午后进一步下行，并低位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2209 收报 100.715，较上个交易日下跌 0.14%；5 年期国债期货主力合约 TF2209 收报 101.590，较上个交易日下跌 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS2209 收报 101.115，较上

个交易日下跌 0.07%。今日主要现券收益率早盘快速上行后震荡，午后进一步上行，截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 220210 收益率报 3.04%/3.04%，剩余期限 9.81 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.785%/2.7825%。

周四美元兑人民币中间价报 6.7411，较上个交易日下调 320 点。今日在岸美元兑人民币上午大幅低开后小幅回升，后持续低位震荡，午后小幅回落后继续震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.7450，较上一交易日贬值 119 个基点；离岸美元兑人民币早盘快速冲高后回落，后再度冲高，宽幅震荡，午后震荡下行后触底反弹，现报 6.7479，较上一交易日升值 34 个基点，目前两岸汇差在 29 个基点附近。美元指数早盘冲高回落后低位震荡，下午进一步下行后触底反弹，后再度回落，现报 106.29，较上一交易日下跌 0.19%。

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