



【2022-09-16】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金零投放零回笼。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.2940%，上涨 6.80 个基点；7 天品种报 1.6430%，上涨 9.60 个基点；1 个月品种报 1.5110%，上涨 0.30 个基点；3 个月品种报 1.5990%，与前一交易日持平。今日资金面整体均衡偏紧，下午三点后国股大行有部分融出，资金面转松，资金利率整体反弹。

今日国家统计局公布了 2022 年 8 月经济数据，数据显示，中国 8 月规模以上工业增加值同比增 4.20%，预期增 3.90%，前值增 3.80%；中国 8 月社会消费品零售总额同比增 5.40%，预期增 4.20%，前值增 2.70%；中国 1-8 月城镇固定资产投资同比增 5.80%，预期为 5.50%，前值增 5.70%。

今日上午发行的 1 年期[220304Z13.IB]、1 年期[220306Z7.IB]、2 年期、7 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.5388%、1.6369%、2.1119%、2.7774%，全场倍数分别为 6.52 倍、5.36 倍、3.34 倍、5.34 倍，边际倍数分别为 1.40 倍、3.75 倍、1.00 倍、1.71 倍。稍后发行的 91 天期贴现国债中标利率为 1.2553%，边际利率为 1.2957%，全场倍数为 4.84

倍，边际倍数为 1.46 倍。同时发行的 50 年期付息续发国债中标利率为 3.1919%，全场倍数为 3.54 倍，边际倍数为 10.74 倍。今日国债期货低开后低位震荡，午后跌幅收窄。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.265，较上个交易日下跌 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.750，较上个交易日下跌 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.135，较上个交易日下跌 0.03%。今日主要现券收益率冲高回落，小幅上行，截至目前，剩余期限 9.61 年的国开债活跃券 220210 收益率报 2.875%/2.873%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.675%/2.67%。

周五美元兑人民币中间价报 6.9305，较上个交易日上调 204 点。今日在岸美元兑人民币大幅高开后高位震荡，下午进一步上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.0166，较上一交易日上涨 391 个基点；离岸美元兑人民币早盘快速下行后触底反弹转升，随后高位震荡，下午 15:00 后再度上行，现报 7.0306，较上一交易日上涨 172 个基点，目前两岸汇差在 140 个基点附近。美元指数早盘冲高回落，后触底反弹，震荡上行，下午 15:00 后涨幅快速扩大，现报 110.06，较上一交易日上涨 0.32%。

以上仅供参考，谢谢！

文/Jason Mao

如果您对本有任何评论与见解
请发电邮至: SHOffice@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