



【2022-02-18】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 200 亿逆回购到期，另外今日还有 2000 亿 MLF 到期，已在本周三续作，当日全口径资金净回笼 2100 亿。Shibor 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 2.1100%，上涨 25.50 个基点；7 天品种报 2.0980%，上涨 9.60 个基点；1 个月品种报 2.3230%，下跌 1.10 个基点；3 个月品种报 2.4000%，下跌 0.60 个基点。今日资金面整体均衡偏紧，国股大行虽有持续融出，但规模较小。

今日上午发行 1 年期、2 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.8560%、2.1907%，全场倍数分别为 3.37 倍、5.34 倍，边际倍数分别为 2.06 倍、32.00 倍。稍后发行的 91 天期贴现国债中标利率为 1.6954%，边际利率为 1.7484%，全场倍数为 2.86 倍，边际倍数为 4.05 倍。同时发行的 30 年期附息续发国债中标利率为 3.3331%，全场倍数为 4.40 倍，边际倍数为 7.07 倍。今日国债期货上午窄幅震荡，午后震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2206 收报 100.220，较上个交易日下跌 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF2206 收报 101.520，较上个交易日下跌 0.16%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.190，较上个交易日下跌 0.03%。今日现券收益率早盘震荡，午后上行，截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.067%/3.065%，剩余期限 9.75 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.7975%/2.795%。

周五美元兑人民币中间价报 6.3343，较上个交易日上调 22 点。今日在岸美元兑人民币低开后低位震荡，下午快速跳水，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3265，较上一交易日贬值 101 个基点；离岸美元兑人民币上午震荡，午后快速下行，现报 6.3219，较上一交易日贬值 122 个基点，目前两岸汇差倒挂在 46 个基点附近。美元指数震荡，下午有所下行，现报 95.74，较上一交易日下跌 0.08%。

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 轻松查看晨报及更多资讯



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