



【2022-10-14】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 580 亿逆回购到期，当日资金净回笼 560 亿。Shibor 利率短端下行，其中隔夜品种报 1.1330%，下跌 4.90 个基点；7 天品种报 1.5940%，下跌 4.40 个基点；1 个月品种报 1.6130%，下跌 0.60 个基点；3 个月品种报 1.6800%，上涨 0.30 个基点。今日资金面总体均衡偏松，国股大行有部分融出，短端资金利率有所回落。

今日国家统计局公布了 2022 年 9 月通胀数据，数据显示，9 月 CPI 同比增 2.8%，预期增 2.9%，前值增 2.5%；9 月 PPI 同比增 0.9%，预期增 1%，前值增 2.3%。

今日上午发行的 1 年期、2 年期、7 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.5696%、2.0676%、2.7920%，全场倍数分别为 3.58 倍、4.19 倍、6.35 倍，边际倍数分别为 1.24 倍、1.41 倍、2.50 倍。稍后发行的 91 天期、182 天期贴现国债、5 年期附息国债中标利率分别为 1.2340%、1.4994%、2.4400%，边际利率分别为 1.3845%、1.5970%、2.4600%，全场倍数分别为 2.21 倍、2.42 倍、3.75 倍，边际倍数分别为 5.46 倍、2.31 倍、3.77 倍。今日国债期货震荡上行，午后涨幅进一步扩大。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.400，较上个交易日上涨 0.27%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.895，较上个交易日上涨 0.16%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.245，较上个交易日上涨 0.07%。今日主

要现券收益率上午小幅下行，午后下行幅度进一步扩大，截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.86%/2.858%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 220017 收益率报 2.697%/2.695%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1088，较上个交易日下调 13 点。今日在岸美元兑人民币开盘后大幅下行，上午低位震荡，下午震荡回升，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.1931，较上一交易日上涨 3 个基点；离岸美元兑人民币上午宽幅震荡，下午大幅上行，现报 7.1997，较上一交易日上涨 218 个基点，目前两岸汇差在 66 个基点附近。美元指数上午冲高回落，后触底反弹，震荡回升，午后涨幅扩大，现报 112.75，较上一交易日上涨 0.26%。

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: 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