



【2022-09-29】

今日央行开展 1050 亿 7 天期、770 亿 14 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金净投放 1800 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 0.9640%，下跌 30.60 个基点；7 天品种报 2.0150%，上涨 26.80 个基点；1 个月品种报 1.7100%，上涨 2.80 个基点；3 个月品种报 1.6660%，上涨 1.40 个基点。在央行持续加码下，今日银行间市场流动性整体维持均衡态势，隔夜、14 天期限资金价格均明显下行。

今天下午发行的 3 年期、7 年期、10 年期、20 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.1507%、2.8541%、2.8577%、3.1906%，全场倍数分别为 3.28 倍、4.05 倍、2.75 倍、6.52 倍，边际倍数分别为 2.62 倍、7.80 倍、5.75 倍、1.63 倍。今日国债期货早盘高开，随后震荡走弱，全线收跌。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 100.625，较上个交易日下跌 0.24%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.415，较上个交易日下跌 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.030，较上个交易日下跌 0.05%。现券收益率早盘一度下行，10 点后大幅走升，午后持续震荡上行，截至目前，剩余期限 9.81 年的国开债活跃券

220215 收益率报 2.9000%/2.8975%，剩余期限 9.88 年的国债活跃券 220017 收益率报 2.7300%/2.725%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1102，较上个交易日下调 5 点。今日在岸美元兑人民币早盘大幅低开，随后震荡走升，离岸美元兑人民币早盘短线回吐 100 个基点后再度走高，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.2000，较上一交易日下跌 458 个基点；离岸美元兑人民币现报 7.2052，较上一交易日上涨 431 个基点，目前两岸汇差在 70 个基点附近。美元指数全天持续走升，现报 113.69，较上一交易日上涨 0.87%。

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