



【2022-11-15】

今日央行开展 1720 亿 7 天期逆回购、8500 亿 1 年期 MLF 操作，有 20 亿逆回购、10000 亿 MLF 到期，当日全口径资金净投放 200 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.8530%，上涨 20.70 个基点；7 天品种报 1.9290%，上涨 8.30 个基点；1 个月品种报 1.8310%，上涨 6.30 个基点；3 个月品种报 2.0090%，上涨 9.70 个基点。今日资金面上午呈现均衡偏紧的态势，午后进一步趋紧，尾盘有部分机构融出，资金面紧张的趋势缓解，资金利率整体上行。

今日国家统计局公布了 2022 年 10 月经济数据，数据显示中国 10 月规模以上工业增加值同比增 5%，预期增 5%，前值增 6.3%；10 月社会消费品零售总额同比降 0.5%，预期增 1.7%，前值增 2.5%；1-10 月固定资产投资同比增 5.8%，预期增 5.9%，前值增 5.9%。

今日上午发行的 3 年期、5 年期、7 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.5364%、2.7103%、2.9045%，全场倍数分别为 5.29 倍、4.76 倍、6.50 倍，边际倍数分别为 1.56 倍、69.00 倍、10.46 倍。下午发行的 2 年期、7 年期农发行上清所托管固息增发债中标利率分别为 2.4022%、2.9381%，全场倍数分别为 4.06 倍、6.25 倍，边际倍数为 1.62 倍、1.76 倍。稍后发行的 1 年期国开行上清所托管固息债中标利率为 2.0900%，全场倍数为 4.04 倍，边际

倍数为 2.53 倍。今日国债期货冲高回落，窄幅震荡，全线收跌。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 100.490，较上个交易日下跌 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.210，较上个交易日下跌 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.940，较上个交易日下跌 0.10%。今日主要现券收益率小幅下行后震荡，截至目前，剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.987%/2.987%，剩余期限 9.81 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.8125%/2.8125%。

周二美元兑人民币中间价报 7.0421，较上个交易日下调 478 点。今日在岸、离岸美元兑人民币上午冲高，午后震荡回落转跌，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.0335，较上一交易日下跌 43 个基点；离岸美元兑人民币现报 7.0270，较上一交易日下跌 147 个基点，目前两岸汇差倒挂在 65 个基点附近。美元指数上午窄幅震荡，午后大幅下行，现报 106.21，较上一交易日下跌 0.64%。

以上仅供参考，谢谢！

文/JasonMao

如果您对本文有任何评论与见解
请发邮箱至：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