【2026-10-26】

今日央行开展 3980 亿隔夜期限、560 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3380 亿，逆回购口径资金净投放 1160 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.3010 %，上行 3.00 个基点；7 天品种报 1.3630%，上行 3.70 个基点；1 个月品种报 1.3820%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.4065%，下行 0.13 个基点。今日资金面整体均衡，尾盘均衡偏松。

下午发行 5 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.4230%、1.6494%，全场倍数分别为 8.71 倍、9.64 倍，边际倍数分别 2.80 倍、1.54 倍。国债期货震荡偏强，主力合约全线上涨。30 年期国债期货主力合约 TL2612 收报 118.000，较上个交易日上涨 0.29%；10 年期国债期货主力合约 T2612 收报 109.890，较上个交易日上涨 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2612 收报 106.800，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2612 收报 102.698，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率下行，截至目前，剩余期限 9.36 年的国开债活跃券 260205 收益率报 1.6670%/1.6650%，剩余期限 9.80 年的国债活跃券 260016 收益率报 1.6260%/1.6255%。

周一美元兑人民币中间价报 6.7162，较上个交易日下调 18 点。今日美元兑在岸人民币、美元兑离岸人民币弱势震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 6.6681，较上一交易日下跌 30 个基点；美元兑离岸人民币现报 6.6674，较上一交易日下跌 17 个基点，目前两岸汇差倒挂 5 个基点附近。美元指数震荡上行，现报 101.80，较上一交易日上涨 0.04%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，10 月 23 日当周三大人民币汇率指数全线下行，CFETS 人民币汇率指数报 103.41，环比下行 0.29；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 111.02，环比下行 0.16；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 98.56，环比下行 0.07。

以上仅供参考，谢谢！

免责声明：本日评由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日评内容。日评所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，信息不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日评任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。