



【2022-10-20】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金零投放零回笼。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.1540%，上涨 3.80 个基点；7 天品种报 1.5810%，上涨 3.40 个基点；1 个月品种报 1.6120%，上涨 0.30 个基点；3 个月品种报 1.6970%，上涨 0.60 个基点。今日资金面早盘均衡，午后融出减少，资金面有所趋紧，资金利率整体回升。

今日中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布，2022 年 10 月 20 日贷款市场报价利率 (LPR)：1 年期为 3.65%，5 年期以上为 4.3%，均与前一月持平。

今日上午发行的 1 年期、3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.5045%、2.2304%、2.5652%、2.9314%，全场倍数分别为 4.19 倍、5.39 倍、4.25 倍、2.96 倍，边际倍数分别为 6.24 倍、1.65 倍、1.00 倍、2.55 倍。下午发行的 3 年期国开行固息增发债、10 年期国开行固息债、20 年期国开行固息增发债中标利率分别为 2.1148%、2.77%、3.1622%，全场倍数分别为 4.50 倍、5.55 倍、4.20 倍，边际倍数分别为 3.00 倍、1.91 倍、7.02 倍。今日国债期货低开后震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.210，较上个交易日下跌 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.840，较上个交易日下跌 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.220，较上个交易日下跌

0.03%。今日主要现券收益率震荡上行，下午有所回落，截至目前，剩余期限 9.75 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.874%/2.873%，剩余期限 9.87 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.72%/2.72%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1188，较上个交易日上调 83 点。今日在岸美元兑人民币早盘冲高回落后震荡下行，午后触底回升，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.2377，较上一交易日上涨 135 个基点；离岸美元兑人民币上午震荡下行，午后触底反弹，跌幅收窄，现报 7.2610，较上一交易日下跌 75 个基点，目前两岸汇差在 233 个基点附近。美元指数冲高回落后低位震荡，现报 112.93，较上一交易日上涨 0.02%。

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