



【2022-10-18】

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 利率短端下行，其中隔夜品种报 1.1340%，下跌 3.30 个基点；7 天品种报 1.5300%，下跌 2.80 个基点；1 个月品种报 1.6100%，下跌 0.30 个基点；3 个月品种报 1.6860%，上涨 0.20 个基点。今日资金面总体均衡偏松，尾盘略有收敛，国股大行有部分融出，资金利率低位震荡。

今日上午发行的 1 年期、5 年期、7 年期国开行固息增发债中标利率分别为 1.5634%、2.4329%、2.7911%，全场倍数分别为 3.92 倍、6.17 倍、6.70 倍，边际倍数分别为 1.23 倍、1.20 倍、2.83 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 2.1097%、2.7935%，全场倍数分别为 4.09 倍、5.80 倍，边际倍数分别为 1.36 倍、1.38 倍。今日国债期货上午小幅下行后触底震荡回升，全天窄幅震荡。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.355，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.875，较上个交易日上涨 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.240，较上个交易日上涨 0.01%。今日主要现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.76 年的国开债

活跃券 220215 收益率报 2.8575%/2.8575%，剩余期限 9.88 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.7025%/2.70%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1086，较上个交易日下调 9 点。今日在岸美元兑人民币低开低位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.1952，较上一交易日下跌 98 个基点；离岸美元兑人民币早盘震荡下行，后低位震荡，现报 7.2041，较上一交易日下跌 58 个基点，目前两岸汇差在 89 个基点附近。美元指数上午冲高回落，午后触底反弹，震荡回升，现报 112.01，较上一交易日下跌 0.08%。

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