



【2022-09-27】

今日央行开展 1130 亿 7 天期、620 亿 14 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金净投放 1730 亿。Shibor 利率短端下行，其中隔夜品种报 1.3990%，下跌 3.00 个基点；7 天品种报 1.6970%，下跌 14.30 个基点；1 个月品种报 1.6650%，上涨 1.90 个基点；3 个月品种报 1.6340%，上涨 1.30 个基点。今日资金面上午均衡偏紧，下午有所趋松，股份行有部分融出。

今日国家统计局公布了 2022 年 8 月中国工业企业利润数据，数据显示 1-8 月全国规模以上工业企业利润同比下降 2.1%，前值下降 1.1%。

今日下午发行的 1 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.5588%、2.6008%、2.9666%，全场倍数分别为 4.38 倍、3.97 倍、3.28 倍，边际倍数分别为 1.16 倍、1.76 倍、10.22 倍。随后发行的 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 2.1106%、2.8357%，全场倍数分别为 2.90 倍、3.38 倍，边际倍数分别为 1.35 倍、1.76 倍。今日国债期货上午低开并进一步下行，后震荡回升，最终收涨。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.025，较上个交易日上涨 0.06%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报

101.635, 较上个交易日上涨 0.03%; 2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.120, 较上个交易日上涨 0.01%。今日主要现券收益率上午窄幅震荡, 下午有所下行, 截至目前, 剩余期限 9.81 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.84%/2.839%, 剩余期限 9.89 年的国债活跃券 220017 收益率报 2.6875%/2.685%。

周二美元兑人民币中间价报 7.0722, 较上个交易日上调 424 点。今日在岸美元兑人民币上午开盘后迅速冲高, 后触顶震荡回落, 下午 15:30 后触底反弹, 涨幅扩大, 截至 16:30, 在岸美元兑人民币收报 7.1580, 较上一交易日上涨 116 个基点; 离岸美元兑人民币震荡下行, 下午 15:30 后触底反弹, 跌幅收窄, 现报 7.1583, 较上一交易日下跌 157 个基点, 目前两岸汇差在 3 个基点附近。美元指数震荡下行, 现报 113.62, 较上一交易日下跌 0.43%。

以上仅供参考, 谢谢!

文/Jason Mao

如果您对本有任何评论与见解
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