

市场概述 每日市场动态

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2021-10-22】

今日央行开展 1000 亿 7 天期逆回购操作，有 100 亿逆回购到期，当日资金净投放 900 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.6720%，下跌 1.10 个基点；7 天品种报 2.0560%，上涨 0.10 个基点；1 个月品种报 2.3700%，上涨 0.40 个基点；3 个月品种报 2.4340%，上涨 0.20 个基点。今日资金面整体均衡偏松，大行国股有部分融出。

今日上午发行的 91 天期、182 天期贴现国债中标利率分别为 1.9803%、2.1859%，边际利率分别为 2.0966%、2.3639%，全场倍数分别为 3.75 倍、2.14 倍，边际倍数分别为 1.57 倍、1.13 倍。下午发行的 1 年期、2 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.2280%、2.6351%，全场倍数分别为 3.72 倍、5.45 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、1.13 倍。国债期货上午震荡，午后下行。10 年期国债期货主力合约 T2112 收报 99.040，较上个交易日下跌 0.08%；5 年期国债期货主力合约 TF2112 收报 100.600，较上个交易日下跌 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2112 收报 100.600，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率上午震荡，午后上行。截至目前，剩余期限 9.62 年的国开债活跃券 210210 收益率报 3.34%/3.34%，剩余期限 9.59 年的国债活跃券 210009 收益率报 2.985%/2.9825%。

周五美元兑人民币中间价报 6.4032，较上个交易日上调 142 点。今日在岸、离岸美元兑人民币上午低开后快速冲高，午间震荡，下午 2:00 后再度回落，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3903，较上一交易日贬值 85 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.3849，较上一交易日贬值 96 个基点，目前两岸汇差倒挂在 54 个基点附近。美元指数震荡下行，下午 2:00 后跌幅快速扩大，现报 93.62，较上个交易日贬值 0.15%。

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：SHResearch@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松查看晨报及更多资讯



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