



【2022-10-26】

今日央行开展 2800 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金净投放 2780 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7750%，上涨 1.20 个基点；7 天品种报 1.9950%，上涨 11.90 个基点；1 个月品种报 1.6570%，上涨 1.80 个基点；3 个月品种报 1.7340%，上涨 1.00 个基点。今日资金面早盘较紧，后随着机构逐渐融出，资金面紧张的情况逐渐缓解，尾盘趋于均衡，非银机构融出显著增加，但资金价格与前期相比仍处高位。

今日下午发行的 182 天期农发行贴现债、1 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 1.5562%、1.6716%、2.9211%，全场倍数分别为 4.24 倍、2.78 倍、3.23 倍，边际倍数分别为 1.08 倍、1.19 倍、1.27 倍。今日国债期货高开后震荡上行，全线收涨。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.395，较上个交易日上涨 0.21%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.935，较上个交易日上涨 0.15%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.285，较上个交易日上涨 0.09%。今日主要现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.8585%/2.856%，剩余期限 9.86 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.71%/2.7025%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1638，较上个交易日下调 30 点。今日在岸美元兑人民币低开低位震荡，午后大幅下行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.1825，较上一交易日下跌 1260 个基点；离岸美元兑人民币早盘冲高回落，下午大幅下行，现报 7.2156，较上一交易日下跌 979 个基点，目前两岸汇差在 331 个基点附近。美元指数上午冲高回落，午后大幅下行，现报 110.20，较上一交易日下跌 0.61%。

以上仅供参考，谢谢！

文/JasonMao

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