

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

【2021-10-20】

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 亿元。Shibor 利率短端下行，长端上行，其中隔夜品种报 2.1040%，下跌 11.90 个基点；7 天品种报 2.2210%，下跌 6.20 个基点；1 个月品种报 2.3630%，上涨 0.10 个基点；3 个月品种报 2.4310%，上涨 0.30 个基点。今日资金面早盘均衡，大行国股有部分融出，后逐渐转松至收盘。

今日中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布，2021 年 10 月 20 日贷款市场报价利率（LPR）为：1 年期 LPR 为 3.85%，5 年期以上 LPR 为 4.65%。LPR 连续 18 个月保持不变。

今日上午发行的 2 年期付息国债、5 年期付息续发国债中标利率分别为 2.5600%、2.8150%，边际利率分别为 2.6000%、2.8365%，全场倍数分别为 2.86 倍、3.02 倍，边际倍数分别为 25.96 倍、2.11 倍。下午发行的 1 年期、3 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.2294%、2.7212%、3.4074%，全场倍数分别为 3.94 倍、6.64 倍、3.77 倍，边际倍数分别为 4.82 倍、4.61 倍、24.18 倍。国债期货高开后震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2112 收报 98.875，较上个交易日下跌 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2112 收报 100.490，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2112 收报 100.540，基本与上个交易日持平。今日现券收益率基本持平。截至目前，剩余期限 9.63 年的国开债活跃券 210210 收益率报 3.3425%/3.34%，剩余期限 9.60 年的国债活跃券 210009 收益率报 3.0075%/3.0025%。

周三美元兑人民币中间价报 6.4069，较上个交易日下调 238 点。今日在岸美元兑人民币低开后低位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3936，较上一交易日贬值 62 个基点；离岸美元兑人民币震荡上行，现报 6.3869，较上一交易日升值 104 个基点，目前两岸汇差倒挂在 67 个基点附近。美元指数震荡，现报 93.80，较上个交易日升值 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：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