



【2022-09-19】

今日央行开展 20 亿 7 天期、100 亿 14 天期逆回购操作，无逆回购到期，当日资金净投放 120 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.4100%，上涨 11.60 个基点；7 天品种报 1.6990%，上涨 5.60 个基点；1 个月品种报 1.5360%，上涨 2.50 个基点；3 个月品种报 1.6010%，上涨 0.20 个基点。受缴税影响，今日资金面整体均衡偏紧，尾盘有所转松，资金利率整体上行。

今日下午发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.3242%、2.6022%，全场倍数分别为 3.53 倍、3.32 倍，边际倍数分别为 3.16 倍、2.01 倍。今日国债期货上午窄幅震荡，下午震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.335，较上个交易日上涨 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.805，较上个交易日上涨 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.165，较上个交易日上涨 0.03%。今日主要现券收益率早盘震荡上行，午后震荡回落，截至目前，剩余期限 9.60 年的国开债活跃券 220210 收益率报 2.88%/2.875%，剩余期限 9.66 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.6725%/2.67%。

周一美元兑人民币中间价报 6.9396，较上个交易日上调 91 点。今日在岸美元兑人民币早盘大幅低开后迅速回升，后震荡，下午进一步上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.0179，较上一交易日上涨 13 个基点；离岸美元兑人民币早盘快速冲高，后震荡上行，现报 7.0224，较上一交易日上涨 239 个基点，目前两岸汇差在 45 个基点附近。美元指数早盘快速下行后触底反弹，全天大幅上行，现报 110.05，较上一交易日上涨 0.35%。

上周最后一个交易日（9 月 16 日）CFETS 人民币汇率指数录得 102.09，按周下跌 0.01；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 107.53，按周上涨 0.07；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 99.73，按周下跌 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：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