



【2022-10-17】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 210 亿逆回购到期，此外，今日还有 5000 亿 MLF 到期，央行等量平价续作，当日全口径资金净回笼 190 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.1670%，上涨 3.40 个基点；7 天品种报 1.5580%，下跌 3.60 个基点；1 个月品种报 1.6130%，与前一交易日持平；3 个月品种报 1.6840%，上涨 0.40 个基点。今日资金面总体均衡，国股大行有部分融出，资金利率低位震荡。

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 2.2925%、2.5836%，全场倍数分别为 2.80 倍、3.85 倍，边际倍数分别为 2.48 倍、46.50 倍。今日国债期货窄幅震荡，10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.335，较上个交易日下跌 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.835，较上个交易日下跌 0.01 %；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.215，较上个交易日下跌 0.01%。今日主要现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.76 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.862%/2.86%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 220017 收益率报 2.70%/2.6975%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1095，较上个交易日上调 7 点。今日在岸美元兑人民币开盘小幅下行，后触底回升，震荡上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.2050，较上一交

易日上涨 119 个基点；离岸美元兑人民币早盘快速下行，后触底震荡回升，现报 7.2208，较上一交易日上涨 35 个基点，目前两岸汇差在 158 个基点附近。美元指数早盘震荡下行，后维持低位震荡，现报 113.12，较上一交易日下跌 0.17%。

上周最后一个交易日（10 月 14 日）CFETS 人民币汇率指数录得 101.83，按周上涨 0.80；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 107.04，按周上涨 0.48；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.40，按周上涨 0.13。

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