



【2022-10-21】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金零投放零回笼。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.2300%，上涨 7.60 个基点；7 天品种报 1.6820%，上涨 10.10 个基点；1 个月品种报 1.6200%，上涨 0.80 个基点；3 个月品种报 1.7020%，上涨 0.50 个基点。今日资金面均衡偏紧，资金融出减少，尾盘股份行有部分融出，紧张趋势有所缓解，资金利率明显回升。

今日上午发行的 1 年期、2 年期、7 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 1.6087%、2.0446%、2.7713%，全场倍数分别为 3.64 倍、5.36 倍、5.00 倍，边际倍数分别为 1.48 倍、4.14 倍、2.30 倍。稍后发行的 182 天期贴现国债中标利率为 1.5308%，边际利率为 1.6581%，全场倍数为 2.69 倍，边际倍数为 12.86 倍。今日国债期货冲高回落，震荡下行，全线收跌。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.125，较上个交易日下跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.755，较上个交易日下跌 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.185，较上个交易日下跌 0.03%。今日主要现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.75 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.8775%/2.874%，剩余期限 9.88 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.7275%/2.726%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1186，较上个交易日下调 2 点。今日在岸美元兑人民币上午小幅冲高，后高位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.2494，较上一交易日上涨 117 个基点；离岸美元兑人民币震荡上行，现报 7.2725，较上一交易日上涨 166 个基点，目前两岸汇差在 231 个基点附近。美元指数震荡上行，下午 15:00 后短暂大幅回落后触底反弹，重回升势，现报 113.19，较上一交易日上涨 0.32%。

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