

# 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

【2021-10-18】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 200 亿逆回购到期，当日资金净回笼 100 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 2.1310%，上涨 6.60 个基点；7 天品种报 2.1740%，上涨 4.20 个基点；1 个月品种报 2.3570%，下跌 0.12 个基点；3 个月品种报 2.4220%，下跌 0.02 个基点。今日资金面早盘均衡，大行国股有部分融出；后边际趋紧，大行国股停止融出。

今日国家统计局公布了 2021 年 9 月及三季度经济数据，数据显示，三季度 GDP 同比增长 4.9%，预期为 5.5%，前值为 7.9%；9 月工业增加值同比增长 3.1%，预期为 3.8%，前值为 5.3%；1-9 月固定资产投资累计同比增长 7.3%，预期为 7.9%，前值为 8.9%；9 月社会消费品零售总额同比增长 4.4%，预期为 3.4%，前值为 2.5%。

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 2.9180%、3.1835%，全场倍数分别为 3.31 倍、4.40 倍，边际倍数分别为 1.40 倍、2.10 倍。国债期货大幅低开后低位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2112 收报 98.670，较上个交易日下跌 0.52%；5 年期国债期货主力合约 TF2112 收报 100.370，较上个交易日下跌 0.33%；2 年期国债期货主力合约 TS2112 收报 100.515，较上个交易日下跌 0.11%。今日现券收益率大幅上行。截至目前，剩余期限 9.64 年的国开债活跃券 210210 收益率报 3.3625%/3.36%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 210009 收益率报 3.04%/3.035%。

周一美元兑人民币中间价报 6.4300，较上个交易日下调 86 点。今日在岸、离岸美元兑人民币上午冲高，午后震荡下行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.4345，较上一交易日升值 54 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.4333，较上一交易日贬值 12 个基点，目前两岸汇差倒挂在 12 个基点附近。美元指数震荡上行，现报 94.10，较上个交易日升值 0.15%。

上周最后一个交易日（10 月 15 日）CFETS 人民币汇率指数录得 99.93，按周上涨 0.08；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 104.28，按周上涨 0.27；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.34，按周上涨 0.34。

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**