【2022-11-11】

今日央行开展 120 亿 7 天期逆回购操作，有 30 亿逆回购到期，当日资金净投放 90 亿。Shibor 利率短端下行，长端上行，其中隔夜品种报 1.7040%，下跌 12.20 个基点；7 天品种报 1.8880%，下跌 5.00 个基点；1 个月品种报 1.7160%，上涨 1.60 个基点；3 个月品种报 1.8680%，上涨 3.00 个基点。今日资金面整体呈现均衡偏松态势，隔夜资金利率大幅下行。

今日上午发行 91 天期、182 天期贴现国债发行利率分别为 1.5720%、1.6835%，边际利率分别为 1.7322%、1.8622%，投标倍数分别为 1.92 倍、2.06 倍，边际倍数分别为 3.12 倍、12.86 倍；上午发行的 1 年期、3 年期、7 年期进出口行固息增发债发行利率分别为 1.9000%、2.1838%、2.8069%，投标倍数分别为 2.56 倍、3.45 倍、3.57 倍，边际倍数分别为 4.00 倍、1.20 倍、1.00 倍。受昨晚公布的金融数据不及预期的影响，国债期货今日早盘高开后震荡回落，午后防疫 20 条措施公布，国债期货全线跳水收跌。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.120，较上个交易日下跌 0.40%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.685，较上个交易日下跌 0.25%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.225，较上个交易日下跌 0.07%。今日主要现券收益率低开高走，防疫新措施公布后直线拉升，截至目前，剩余期限

9.69 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.9125%/2.91%，剩余期限 9.82 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.7350%/2.7330%。

周五美元兑人民币中间价报 7.107，较上个交易日大幅下调 515 点。今日在岸美元兑人民币早盘走弱，午后跳水跌幅扩大，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.1106，较上一交易日下跌 1368 个基点；离岸美元兑人民币现报 7.0933，较上一交易日下跌 593 个基点，目前两岸汇差在 130 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 107.39，较上一交易日下跌 0.45%。

以上仅供参考，谢谢！

文/JasonMao

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