



【2022-10-31】

今日央行开展 700 亿 7 天期逆回购操作，有 100 亿逆回购到期，当日资金净投放 600 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7390%，上涨 41.20 个基点；7 天品种报 1.9520%，下跌 1.10 个基点；1 个月品种报 1.6800%，上涨 0.50 个基点；3 个月品种报 1.7450%，上涨 0.20 个基点。今日资金面总体偏紧，上午在较低价格上机构鲜有融出，下午机构融出增加，但提价明显，隔夜利率大幅上行，尾盘有所回落。

今日国家统计局公布了 2022 年 10 月官方 PMI 数据，数据显示 10 月官方制造业 PMI 为 49.2，预期为 49.8，前值为 50.1；官方非制造业 PMI 为 48.7，预期为 50.1，前值为 50.6；官方综合 PMI 为 49，前值为 50.9。

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 2.2156%、2.5312%，全场倍数分别为 2.55 倍、3.11 倍，边际倍数分别为 1.25 倍、1.33 倍。今日国债期货高开后小幅回落，高位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.770，较上个交易日上涨 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 102.185，较上个交易日上涨 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.370，与上个交易日相比变动不大。今日主要现券收益率

有所下行，截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.845%/2.8425%，
剩余期限 9.84 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.644%/2.64%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1768，较上个交易日上调 70 点。今日在岸、离岸美元兑人民币大幅上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.2985，较上一交易日上涨 420 个基点；
离岸美元兑人民币现报 7.3232，较上一交易日上涨 532 个基点，目前两岸汇差在 247 个基点附近。美元指数上午冲高回落，午后再度上行，涨幅扩大，现报 111.18，较上一交易日上涨 0.46%。

上周最后一个交易日（10 月 28 日）CFETS 人民币汇率指数录得 99.87，按周下跌 1.73；
参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 105.28，按周下跌 1.78；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.62，按周下跌 1.74。

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