



## 【2022-11-01】

今日央行开展 150 亿 7 天期逆回购操作，有 2300 亿逆回购到期，当日资金净回笼 2150 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.8430%，上涨 10.40 个基点；7 天品种报 1.8290%，下跌 12.30 个基点；1 个月品种报 1.6830%，上涨 0.30 个基点；3 个月品种报 1.7500%，上涨 0.50 个基点。今日资金面早盘均衡，上午融出较少，有所收紧，午盘开始融出增加，资金面逐渐转松，尾盘隔夜资金利率明显下行。

今日财新公布了中国 10 月制造业 PMI，数据录得为 49.2，前值为 48.1。

今日上午发行的 1 年期、3 年期国开行固息增发债中标利率分别为 1.5891%、2.1429%，全场倍数分别为 3.38 倍、5.81 倍，边际倍数分别为 1.30 倍、3.78 倍。今日下午发行的 2 年期、7 年期农发行上清所托管固息增发债中标利率分别为 2.1045%、2.7619%，全场倍数分别为 3.53 倍、4.72 倍，边际倍数分别为 4.39 倍、3.78 倍。今日国债期货震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.590，较上个交易日下跌 0.19%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 102.090，较上个交易日下跌 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.345，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

9.72 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.8575%/2.855%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.6625%/2.66%。

周二美元兑人民币中间价报 7.2081，较上个交易日上调 313 点。今日在岸美元兑人民币高开后震荡回落，下午快速下行，后低位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.2719，较上一交易日下跌 266 个基点；离岸美元兑人民币震荡下行，午后跌幅扩大，现报 7.2896，较上一交易日下跌 471 个基点，目前两岸汇差在 177 个基点附近。美元指数大幅下行，现报 110.91，较上一交易日下跌 0.61%。

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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)