



【2022-11-02】

今日央行开展 180 亿 7 天期逆回购操作，有 2800 亿逆回购到期，当日资金净回笼 2620 亿。Shibor 利率短端下行，其中隔夜品种报 1.7550%，下跌 8.80 个基点；7 天品种报 1.7710%，下跌 5.80 个基点；1 个月品种报 1.6840%，上涨 0.10 个基点；3 个月品种报 1.7520%，上涨 0.20 个基点。今日资金面早盘均衡，国股大行有融出，后资金面一路趋松，但隔夜资金价格仍高于前期水平。

今日上午发行的 2 年期、5 年期附息续发国债中标利率分别为 1.9969%、2.4084%，边际利率分别为 2.0202%、2.4304%，全场倍数分别为 4.08 倍、3.88 倍，边际倍数分别为 1.42 倍、5.05 倍。下午发行的 181 天期农发行贴现债、1 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 1.5648%、1.6494%、2.9217%，全场倍数分别为 4.36 倍、2.38 倍、2.72 倍，边际倍数分别为 2.14 倍、1.00 倍、4.74 倍。今日国债期上午窄幅震荡，下午开盘后迅速跳水，后触底震荡回升，跌幅收窄。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.525，较上个交易日下跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 102.030，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.330，较上个交易日下跌 0.01%。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 2.87%/2.869%，
剩余期限 9.84 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.682%/2.681%。

周三美元兑人民币中间价报 7.2197，较上个交易日上调 116 点。今日在岸美元兑人民币
上午冲高回落，后震荡，下午再度上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.2825，较上一
交易日上涨 106 个基点；离岸美元兑人民币上午震荡下行，下午触底回升，跌幅收窄，现报
7.2963，较上一交易日下跌 118 个基点，目前两岸汇差在 138 个基点附近。美元指数震荡下
行，现报 111.15，较上一交易日下跌 0.37%。

以上仅供参考，谢谢！

文/JasonMao

如果您对本文有任何评论与见解
请发邮箱至：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