



【2022-09-07】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金零回笼零投放。Shibor 利率短端上行，其中隔夜品种报 1.1130%，上涨 4.40 个基点；7 天品种报 1.5240%，上涨 7.50 个基点；1 个月品种报 1.5000%，与前一交易日持平；3 个月品种报 1.6000%，与前一交易日持平。今日资金面整体均衡，国股大行有部分融出，资金利率小幅反弹。

今日海关总署公布了 2022 年 8 月进出口数据，数据显示，以美元计，中国 8 月出口同比增长 7.1%，预期增 13.5%，前值增 18%；进口增长 0.3%，预期增 1.6%，前值增 2.3%；贸易顺差 793.9 亿美元，预期 963.7 亿美元，前值 1012.6 亿美元。以人民币计，中国 8 月出口增长 11.8%，前值增 23.9%；进口增长 4.6%，前值增 7.4%；贸易顺差 5359.1 亿元，前值 6826.9 亿元。

今日上午发行的 28 天期、63 天期贴现国债、1 年期、5 年期附息续发国债中标利率分别为 0.9549%、1.1837%、1.6269%、2.3363%，边际利率分别为 1.0567%、1.2483%、1.6643%、2.3519%，全场倍数分别为 3.30 倍、4.81 倍、2.79 倍、4.53 倍，边际倍数分别为 1.37 倍、1.43 倍、1.33 倍、1.02 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 1.3500%、1.6477%、2.8916%，全场倍数分别为 5.58 倍、2.92 倍、4.08 倍，边际倍数分别为 1.50 倍、2.79 倍、8.83 倍。今日国债期货窄幅震荡，下午震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.595，较上个交易日下跌 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 102.010，较上个交易日下跌 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.265，较上个交易日下跌 0.01%。今日主要现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.63 年的国开债活跃券 220210 收益率报 2.849%/2.846%，剩余期限 9.69 年的国债活跃券 220010 收益率报 2.627%/2.6255%。

周三美元兑人民币中间价报 6.9160，较上个交易日上调 64 点。今日在岸美元兑人民币早盘高开，后冲高回落，高位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.9715，较上一交易日上涨 230 个基点；离岸美元兑人民币冲高回落，高位震荡，现报 6.9868，较上一交易日上涨 165 个基点，目前两岸汇差在 153 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 110.31，较上一交易日上涨 0.06%。

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