



【2022-11-07】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，有 700 亿逆回购到期，当日资金净回笼 680 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.6200%，上涨 23.40 个基点；7 天品种报 1.7860%，上涨 8.40 个基点；1 个月品种报 1.6770%，上涨 0.20 个基点；3 个月品种报 1.7690%，上涨 1.50 个基点。今日资金面早盘均衡，上午融出较少，资金面有所收敛，午后融出有所增加，资金面逐渐趋于平衡，隔夜资金利率明显上行。

今日海关总署公布了 2022 年 10 月进出口数据，数据显示，以美元计，10 月出口同比降 0.3%，预期增 3.4%，前值增 5.7%；进口降 0.7%，预期增 0.3%，前值增 0.3%；贸易顺差 851.5 亿美元，预期 920 亿美元，前值 847.4 亿美元。以人民币计，10 月出口同比增 7.0%，预期增 12.7%，前值增 10.7%；进口同比增 6.8%，预期增 10%，前值增 5.2%；贸易顺差 5868.1 亿元，预期 7029 亿元，前值为 5735.7 亿元。下午人民银行公布了 2022 年 10 月外汇储备数据，数据显示，10 月末外汇储备为 3.0524 万亿美元，预期为 3.0390 万亿美元，前值为 3.0289 万亿美元。

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 2.2962%、2.5836%，全场倍数分别为 2.50 倍、3.97 倍，边际倍数分别为 9.47 倍、1.31 倍。今日国债期货高开后

高位震荡，午后震荡中枢下移。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.435，较上个交易
日上涨 0.08%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.950，较上个交易日上涨 0.03%；
2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.340，较上个交易日上涨 0.03%。今日主要现券收
益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.71 年的国开债活跃券 220215 收益率报
2.874%/2.8725%，剩余期限 9.83 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.70%/2.6975%。

周一美元兑人民币中间价报 7.2292，较上个交易日下调 263 点。今日在岸美元兑人民币
早盘低开后低位震荡，下午冲高回落，跌幅收窄，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.2405，
较上一交易日下跌 298 个基点；离岸美元兑人民币早盘高开后震荡下行，午后冲高后触顶回
落，现报 7.2387，较上一交易日上涨 607 个基点，目前两岸汇差倒挂在 18 个基点附近。美元
指数上午高位震荡，下午冲高回落后大幅下行，现报 110.77，较上一交易日下跌 0.01%。

上周最后一个交易日（11 月 4 日）CFETS 人民币汇率指数录得 99.68，按周下跌 0.19；
参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 104.94，按周下跌 0.34；参考 SDR 货币篮子的人民
币汇率指数录得 96.59，按周下跌 0.03。

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