

市场概述 每日市场动态

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2022-03-07】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 3000 亿逆回购到期，当日资金净回笼 2900 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 2.0390%，上涨 13.70 个基点；7 天品种报 2.0680%，上涨 2.00 个基点；1 个月品种报 2.3000%，与前一交易日持平；3 个月品种报 2.3600%，下跌 0.20 个基点。今日资金面整体均衡，国股大行有部分融出。

今日海关总署公布了 2022 年 1-2 月进出口数据，数据显示，以人民币计，出口 3.47 万亿元，增长 13.6%；进口 2.73 万亿元，增长 12.9%；贸易顺差 7388 亿元，增加 16.3%。以美元计，出口 5447 亿美元，增长 16.3%；进口 4287.5 亿美元，增长 15.5%；贸易顺差 1159.5 亿美元，增加 19.5%。

今日上午发行的 3 年期农发行固息债、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.6100%、2.8490%，全场倍数分别为 3.84 倍、3.63 倍，边际倍数分别为 2.63 倍、3.63 倍。今日国债期货早盘低开后低位震荡，午后反弹转升。10 年期国债期货主力合约 T2206 收报 99.880，较上个交易日上涨 0.11%；5 年期国债期货主力合约 TF2206 收报 101.340，较上个交易日上涨 0.16%；2 年期国债期货主力合约 TS2206 收报 101.135，较上个交易日上涨 0.08%。今日现券收益率早盘震荡上行，午后回落，截至目前，剩余期限 9.52 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.125%/3.125%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.8325%/2.83%。

周一美元兑人民币中间价报 6.3478，较上个交易日上调 190 点。今日在岸、离岸美元兑人民币早盘冲高后震荡回落，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3183，较上一交易日贬值 6 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.3243，较上一交易日贬值 24 个基点，目前两岸汇差在 60 个基点附近。美元指数早盘快速冲高，后震荡回落，下午 16:00 后再度回升，现报 98.99，较上一交易日上涨 0.49%。

上周最后一个交易日（3 月 4 日）CFETS 人民币汇率指数录得 105.53，按周上涨 1.12；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 109.05，按周上涨 0.65；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 102.14，按周上涨 0.34。

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 轻松查看晨报及更多资讯



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