



【2022-10-24】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 20 亿逆回购到期，当日资金净投放 80 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.3940%，上涨 16.40 个基点；7 天品种报 1.7260%，上涨 4.40 个基点；1 个月品种报 1.6280%，上涨 0.80 个基点；3 个月品种报 1.7100%，上涨 0.80 个基点。今日资金面早盘均衡偏紧，全天资金融出较少，午后资金面紧张的态势进一步加剧，资金利率明显回升。

今日国家统计局公布了 2022 年 9 月及第三季度经济数据，数据显示，第三季度 GDP 同比增 3.9%，预期增 3.3%，前值增 0.4%；9 月规模以上工业增加值同比增 6.3%，预期增 4.8%，前值增 4.2%；9 月社会消费品零售总额同比增 2.5%，预期增 3%，前值增 5.4%；1 至 9 月城镇固定资产投资同比增 5.9%，预期增 6%，前值增 5.8%。

海关总署公布了 2022 年 9 月进出口数据，数据显示，以美元计价，9 月出口同比增长 5.7%，预期增 5.8%，前值增 7.1%；进口增长 0.3%，预期增 1.3%，前值增 0.3%；贸易顺差 847.4 亿美元，预期 812.8 亿美元，前值 793.9 亿美元。以人民币计价，9 月出口同比增长 10.7%，预期增 11.30%，前值增 11.8%；进口增长 5.2%，预期增 8.40%，前值增 4.6%；贸易顺差 5735.7 亿元，前值 5359.1 亿元。

今日上午发行的 1 年期附息国债中标利率为 1.6700%，边际利率为 1.7100%，全场倍数为 3.36 倍，边际倍数为 1.04 倍。同时发行的 30 年期附息国债中标利率为 3.1200%，全场倍数为 5.45 倍，边际倍数为 1.04 倍。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 2.2840%、2.5662%，全场倍数分别为 4.09 倍、4.22 倍，边际倍数分别为 4.02 倍、1.16 倍。今日国债期货小幅低开，后震荡走高，全线收涨。10 年期国债期货主力合约 T2212 收报 101.315，较上个交易日上涨 0.17%；5 年期国债期货主力合约 TF2212 收报 101.855，较上个交易日上涨 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2212 收报 101.225，较上个交易日上涨 0.03%。今日主要现券收益率明显下行，截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 220215 收益率报 2.859%/2.8575%，剩余期限 9.86 年的国债活跃券 220019 收益率报 2.715%/2.713%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1230，较上个交易日上调 44 点。今日在岸美元兑人民币上午迅速冲高后震荡，午后进一步上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 7.2610，较上一交易日上涨 116 个基点；离岸美元兑人民币大幅上行，现报 7.2980，较上一交易日上涨 685 个基点，目前两岸汇差在 370 个基点附近。美元指数震荡上行，现报 112.42，较上一交易日上涨 0.51%。

上周最后一个交易日（10 月 21 日）CFETS 人民币汇率指数录得 101.60，按周下跌 0.23；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 107.06，按周上涨 0.02；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 98.36，按周下跌 0.04。

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