



【2021-12-07】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 1000 亿逆回购到期，当日资金净回笼 900 亿。Shibor 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 2.1300%，上涨 31.30 个基点；7 天品种报 2.1590%，上涨 3.00 个基点；1 个月品种报 2.3570%，下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 2.4880%，下跌 0.40 个基点。今日资金面整体呈现先紧后松的态势，早盘国股大行有部分融出，资金面均衡；后国股大行融出减少，资金面逐渐趋紧；尾盘随着国股大行融出增加，资金面转松。

今日中国海关总署公布了 11 月进出口数据，数据显示，以人民币计，11 月份我国出口 2.09 万亿元，同比增长 16.6%，比 2019 年同期增长 33.4%；进口 1.63 万亿元，同比增长 26%，比 2019 年同期增长 25%；贸易顺差 4606.8 亿元，同比减少 7.7%。以美元计，11 月份我国出口 3255.3 亿美元，同比增长 22%，比 2019 年同期增长 47%；进口 2538.1 亿美元，同比增长 31.7%，比 2019 年同期增长 37.7%；贸易顺差 717.2 亿美元，同比减少 3.4%。

今日国债期货大幅下行。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 99.805，较上个交易日下跌 0.42%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.055，较上个交易日下跌 0.16%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 100.780，较上个交易日下跌 0.05%。今日现券收益率从低位震荡上行。截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.09%/3.09%，剩余期限 9.47 年的国债活跃券 210009 收益率报 2.8775%/2.875%。

周二美元兑人民币中间价报 6.3738，较上个交易日上调 36 点。今日在岸美元兑人民币早盘高位回落，后震荡回升，午后再度下行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3678，较上一交易日贬值 37 个基点；离岸美元兑人民币早盘快速下行后震荡，午后进一步下行，现报 6.3689，较上一交易日贬值 62 个基点，目前两岸汇差在 11 个基点附近。美元指数早盘高位迅速回落，午后低位震荡，现报 96.20，较上个交易日下跌 0.09%。

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