



【2021-12-17】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购，有 100 亿逆回购到期，当日资金零投放零回笼。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.8620%，下跌 25.40 个基点；7 天品种报 2.1510%，下跌 5.80 个基点；1 个月品种报 2.3680%，上涨 0.20 个基点；3 个月品种报 2.4920%，上涨 0.10 个基点。今日资金整体均衡偏松，国股大行有部分融出，隔夜期限加权加点融出。

今日上午发行的 1 年期、2 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.1214%、2.3726%，全场倍数分别为 4.06 倍、4.52 倍，边际倍数分别为 3.25 倍、1.51 倍。稍后发行的 91 天期贴现国债中标利率为 2.1611%，边际利率为 2.3075%，全场倍数为 1.92 倍、边际倍数为 1.17 倍。同时发行的 50 年期附息续发国债中标利率为 3.4316%，全场倍数为 3.50 倍，边际倍数为 3.76 倍。国债期货上午震荡上行，下午小幅回落。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.080，较上个交易日上涨 0.16%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.265，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 100.890，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率上午震荡下行，下午小幅回升。截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.0925%/3.0925%，剩余期限 9.44 年的国债活跃券 210009 收益率报 2.895%/2.89%。

周五美元兑人民币中间价报 6.3651，较上个交易日上调 14 点。今日在岸美元兑人民币上午窄幅震荡，下午 15:00 后震荡上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3742，较上一交易日升值 63 个基点；离岸美元兑人民币早盘震荡下行，午后反弹转升，现报 6.3819，较上一交易日升值 12 个基点，目前两岸汇差在 77 个基点附近。美元指数宽幅震荡，上午震荡上行，午后快速跳水后触底反弹，下午 16:00 后再度回落，现报 96.00，较上个交易日上涨 0.01%。

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