

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

【2021-12-31】

今日央行开展 1000 亿 7 天期逆回购操作，有 100 亿逆回购到期，当日资金净投放 900 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 2.1290%，上涨 85.30 个基点；7 天品种报 2.2710%，下跌 5.00 个基点；1 个月品种报 2.4310%，上涨 0.10 个基点；3 个月品种报 2.5000%，下跌 0.10 个基点。今日为 2021 年最后一个交易日，早盘资金面均衡，后转为充裕偏宽松，成交较为清淡。

今日国家统计局公布了 2021 年 12 月官方 PMI 数据，数据显示 2021 年 12 月官方制造业 PMI 为 50.1，预期值为 50，前值为 50.3，非制造业 PMI 为 52.7，预期为 52，前值为 52.3。

今日国债期上午低开后震荡上行，午后再度震荡下行，下午 13:30 左右触底反弹并震荡。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.735，较上个交易日下跌 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.710，较上个交易日下跌 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.080，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率小幅上行后震荡。截至目前，剩余期限 9.70 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.0775%/3.0775%，剩余期限 9.88 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.775%/2.77%。

周五美元兑人民币中间价报 6.3757，较上个交易日上调 83 点。今日在岸美元兑人民币早盘低开，上午小幅冲高后回落并震荡，下午 16:00 后跌幅进一步扩大，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3730，较上一交易日贬值 63 个基点；离岸美元兑人民币震荡下行，下午 16:00 后跌幅迅速扩大，现报 6.3675，较上一交易日贬值 81 个基点，目前两岸汇差倒挂在 55 个基点附近。美元指数震荡上行，现报 96.02，较上个交易日上涨 0.06%。

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