



【2022-01-17】

今日央行开展 1000 亿 7 天期逆回购、7000 亿 1 年期 MLF 操作，中标利率均下降 10 个基点，有 100 亿逆回购、5000 亿 MLF 到期，当日全口径资金净投放 2900 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 2.1130%，下跌 9.60 个基点；7 天品种报 2.1830%，下跌 3.00 个基点；1 个月品种报 2.4280%，下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 2.4990%，下跌 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡，后随着央行公开市场大额投放及降息，资金面转松，国股大行有部分融出。

今日国家统计局公布了中国 2021 年第四季度及全年经济数据，数据显示，中国 2021 年第四季度 GDP 同比增长 4%，预期增长 3.8%，前值增长 4.9%，2021 年全年 GDP 同比增长 8.1%；中国 2021 年 12 月规模以上工业增加值同比增长 4.3%，预期增长 3.7%，前值增长 3.8%；中国 2021 年固定资产投资同比增长 4.9%，预期增长 5.0%，前值增长 5.2%；中国 2021 年 12 月社会消费品零售总额同比增长 1.7%，预期增长 3.9%，前值增长 3.9%。

今日下午发行 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.4815%、2.7368%，全场倍数分别为 4.64 倍、4.73 倍，边际倍数分别为 1.68 倍、1.90 倍。今日国债期货短端高开后震荡；长端高开后震荡下行，涨幅收窄。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.730，较上个交易日上涨 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.800，较上个交易日上涨 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.120，较上个交易日上涨 0.07%。今日现券收益率上午快速回落，并迅速触底反弹，后窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.65 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.082%/3.08%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.7875%/2.785%。

周一美元兑人民币中间价报 6.3599，较上个交易日下调 78 点。今日在岸美元兑人民币上午高开后震荡下行，下午震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3466，较上一交易日升值 31 个基点；离岸美元兑人民币上午冲高回落，午后震荡，现报 6.3502，较上一交易日贬值 78 个基点，目前两岸汇差在 36 个基点附近。美元指数上午冲高回落，下午小幅反弹后再度回落转跌，现报 95.07，较上个交易日贬值 0.10%。

上周最后一个交易日（1 月 14 日）CFETS 人民币汇率指数录得 102.14，按周下跌 0.84；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 106.21，按周下跌 0.86；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 99.86，按周下跌 0.64。

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