

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

【2022-01-14】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，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 2.2090%，下跌 0.90 个基点；7 天品种报 2.2130%，上涨 1.10 个基点；1 个月品种报 2.4290%，较上一交易日上涨 0.20 个基点；3 个月品种报 2.5000%，与前一交易日持平。今日资金面早盘均衡偏紧，后随着国股大行有部分融出，午后资金面趋松。

今日国家海关总署公布了 2021 年 12 月进出口数据，数据显示，以美元计，12 月出口同比增长 20.9%，预期 18.2%，前值 22%；进口增 19.5%，预期 22%，前值 31.7%；贸易顺差 944.6 亿美元，前值 717.1 亿美元。以人民币计，12 月出口同比增长 17.3%，预期 16.3%，前值 16.6%；进口增 16%，预期 23.6%，前值 26%；贸易顺差 6046.9 亿元，前值 4606.8 亿元。

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 2.0579%、2.3618%，全场倍数分别为 4.07 倍、4.58 倍，全场倍数分别为 1.34 倍、2.92 倍。稍后发行的 91 天期贴现国债中标利率为 1.9139%，边际利率为 1.9751%，全场倍数为 4.43 倍，边际倍数为 15.81 倍。同时发行的 30 年期附息国债中标利率为 3.3189%，全场倍数为 4.31 倍，边际倍数为 2.86 倍。今日国债期货上午冲高回落，下午窄幅震荡。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.675，与上个交易日基本持平；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.665，较上个交易日下跌 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.050，较上个交易日下跌 0.01%。今日现券收益率窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.66 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.084%/3.083%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.7925%/2.79%。

周五美元兑人民币中间价报 6.3677，较上个交易日上调 135 点。今日在岸、离岸美元兑人民币上午窄幅震荡，下午大幅下行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3435，较上一交易日贬值 163 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.3452，较上一交易日贬值 192 个基点，目前两岸汇差在 17 个基点附近。美元指数上午震荡下行，下午 14:45 快速反弹后震荡，现报 94.72，较上个交易日贬值 0.15%。

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