

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

【2021-11-15】

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。央行另外还开展了 10000 亿 1 年期 MLF 操作，利率维持不变，对冲了本月中和月末即将到期的 8000 亿和 2000 亿 MLF。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.7870%，下跌 6.90 个基点；7 天品种报 2.1000%，下跌 2.40 个基点；1 个月品种报 2.3590%，下跌 2.30 个基点；3 个月品种报 2.4600%，上涨 0.60 个基点。今日资金面整体均衡，国股大行有部分融出。隔夜期限资金早盘加点融出，午后加权融出。

今日国家统计局公布了 10 月经济数据，数据显示，中国 10 月社会消费品零售总额同比增 4.9%，预期增 3.4%，前值增 4.4%；中国 1-10 月固定资产投资同比增 6.1%，预期增 6.3%，1-9 月增 7.3%；中国 10 月规模以上工业增加值同比增 3.5%，预期增 3.2%，前值增 3.1%。

今日下午发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.7341%、3.0020%，全场倍数分别为 6.99 倍、6.32 倍，边际倍数分别为 221.00 倍、1.67 倍。国债期货震荡上行，下午 2:30 后快速拉升涨幅进一步扩大。10 年期国债期货主力合约 T2112 收报 100.075，较上个交易日上涨 0.25%；5 年期国债期货主力合约 TF2112 收报 101.145，较上个交易日上涨 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS2112 收报 100.885，较上个交易日上涨 0.04%。今日现券收益率震荡下行。截至目前，剩余期限 9.56 年的国开债活跃券 210210 收益率报 3.2375%/3.235%，剩余期限 9.53 年的国债活跃券 210009 收益率报 2.925%/2.92%。

周一美元兑人民币中间价报 6.3896，较上个交易日下调 169 点。今日在岸美元兑人民币低开后低位震荡，尾盘跌幅进一步扩大，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3803，较上一交易日贬值 99 个基点；离岸美元兑人民币低位震荡，下午 4:00 后跌幅扩大，现报 6.3747，较上一交易日贬值 49 个基点，目前两岸汇差倒挂在 56 个基点附近。美元指数上午大幅跳水后震荡，午后大幅反弹，现报 95.03，较上个交易日下跌 0.09%。

上周最后一个交易日（11 月 12 日）CFETS 人民币汇率指数录得 101.08，按周上涨 0.25；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 105.25，按周上涨 0.10；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 99.49，按周上涨 0.28。

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