



【2022-01-12】

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 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.9720%，下跌 1.20 个基点；7 天品种报 2.0980%，下跌 3.30 个基点；1 个月品种报 2.4280%，较上一交易日下跌 0.10 个基点；3 个月品种报 2.5000%，与前一交易日持平。今日资金面整体均衡，早盘国股大行有部分融出，尾盘融出减少，隔夜资金加权加点融出。

今日上午国家统计局公布了 2021 年 12 月通货膨胀数据，数据显示，2021 年 12 月 CPI 同比增长 1.5%，预期为 1.7%，前值为 2.3%；PPI 同比增长 10.3%，预期为 11.3%，前值为 12.9%。下午人民银行公布了 2021 年 12 月金融数据，数据显示，2021 年 12 月社会融资规模增量 23700 亿元，前值为 26141 亿元；新增人民币贷款 11300 亿元，前值为 12732 亿元；货币供应量 M2 同比增 9.0%，前值为 8.5%；

今日上午发行的 1 年期付息国债、10 年期付息续发国债中标利率分别为 2.1000%、2.7590%，边际利率分别为 2.1400%、2.7901%，全场倍数分别为 3.69 倍、4.10 倍，边际倍数分别为 1.63 倍、4.10 倍。下午发行的 1 年期、5 年期、7 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.0420%、2.3008%、3.1207%，全场倍数分别为 3.52 倍、6.46 倍、3.63 倍，边际倍数分别为 3.52 倍、5.76 倍、3.42 倍。今日国债期货高开后一路震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.635，较上个交易日下跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.675，较上个交易日下跌 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 101.065，与上个交易日基本持平。今日现券收益率上午小幅下行后震荡回升，下午震荡上行。截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.085%/3.0825%，剩余期限 9.85 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.7965%/2.796%。

周三美元兑人民币中间价报 6.3658，较上个交易日下调 26 点。今日在岸美元兑人民币低开后低位震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3646，较上一交易日贬值 72 个基点；离岸美元兑人民币上午快速下行后低位震荡，现报 6.3711，较上一交易日贬值 61 个基点，目前两岸汇差在 65 个基点附近。美元指数上午震荡下行，下午 2:30 后快速反弹转升，后震荡，现报 95.64，较上个交易日升值 0.05%。

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