



【2021-12-16】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购，有 100 亿逆回购到期，当日资金零投放零回笼。Shibor 利率短端涨跌互现，长端基本持平，其中隔夜品种报 2.1160%，下跌 2.10 个基点；7 天品种报 2.2090%，上涨 0.80 个基点；1 个月品种报 2.3660%，上涨 0.20 个基点；3 个月品种报 2.4910%，下跌 0.20 个基点。今日资金整体均衡，早盘隔夜及 7 天期限资金价格较昨日小幅上行，后国股大行少量融出，资金价格回落。

今日上午发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出口行固息增发债中标利率分别为 2.5830%、2.8561%、3.1718%，全场倍数分别为 5.28 倍、5.49 倍、5.19 倍，边际倍数分别为 1.85 倍、4.17 倍、3.36 倍。国债期货上午低开 after 震荡下行，下午低位震荡。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 99.975，较上个交易日下跌 0.14%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.265，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 100.895，较上个交易日下跌 0.01%。今日现券收益率上午震荡上行，下午震荡。截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.095%/3.0925%，剩余期限 9.44 年的国债活跃券 210009 收益率报 2.8915%/2.89%。

周四美元兑人民币中间价报 6.3637，较上个交易日下调 79 点。今日在岸美元兑人民币窄幅震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3679，较上一交易日升值 27 个基点；离岸美元兑人民币早盘冲高回落 after 低位震荡，现报 6.3743，较上一交易日贬值 11 个基点，目前两岸汇差在 64 个基点附近。美元指数早盘快速冲高 after 震荡，下午 14:00 后大幅跳水转跌，现报 96.26，较上个交易日下跌 0.09%。

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