

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

【2021-12-20】

今日央行开展 100 亿 7 天期、100 亿 14 天期逆回购操作，有 100 亿逆回购到期，当日资金净投放 100 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.9940%，上涨 13.20 个基点；7 天品种报 2.1210%，下跌 3.00 个基点；1 个月品种报 2.3810%，上涨 1.30 个基点；3 个月品种报 2.4920%，与上一交易日持平。今日资金整体均衡，国股大行早盘有少量融出；午间资金稍紧，午后回归均衡。

今日中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布，2021 年 12 月 20 日贷款市场报价利率（LPR）为：1 年期 LPR 为 3.8%，5 年期以上 LPR 为 4.65%。1 年期 LPR 为 2020 年 4 月以来首度调整。

今日国债期货上午低开后震荡回升，下午小幅下行。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.055，较上个交易日下跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.205，较上个交易日下跌 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 100.845，较上个交易日下跌 0.05%。今日现券收益率窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.095%/3.0935%，剩余期限 9.43 年的国债活跃券 210009 收益率报 2.895%/2.89%。

周一美元兑人民币中间价报 6.3933，较上个交易日上调 282 点。今日在岸美元兑人民币早盘高开后快速下行，涨幅收窄，后震荡，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3781，较上一交易日升值 39 个基点；离岸美元兑人民币早盘小幅跳水后震荡回升，现报 6.3889，较上一交易日升值 3 个基点，目前两岸汇差在 108 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 96.60，较上个交易日下跌 0.08%。

上周最后一个交易日（12 月 17 日）CFETS 人民币汇率指数录得 102.80，按周下跌 0.06；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 107.10，按周上涨 0.06；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 100.52，按周下跌 0.22。

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