



【2022-03-11】

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 利率多数上行，其中隔夜品种报 2.0510%，上涨 2.60 个基点；7 天品种报 2.1020%，上涨 2.00 个基点；1 个月品种报 2.3000%，与前一交易日持平；3 个月品种报 2.3620%，与前一交易日持平。今日资金面早盘均衡，国股大行有融出较少，午后融出增加，资金面略有转松。

今日中国人民银行公布了 2022 年 2 月金融数据，数据显示，中国 2 月社会融资规模增量为 11900 亿元，预估为 22150 亿元，前值为 61726 亿元；中国 2 月份货币供应量 M2 同比增加 9.2%，预估 9.6%，前值 9.8%；中国 2 月份新增人民币贷款 12300 亿元，预估 14500 亿元，前值 39800 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 2.1893%、2.5405%，全场倍数分别为 2.07 倍、3.65 倍，边际倍数分别为 1.56 倍、2.79 倍。稍后发行的 91 天期贴现国债中标利率为 1.8313%，边际利率为 1.8860%，全场倍数为 2.79 倍，边际倍数为 4.71 倍。同时发行的 30 年期附息续发国债中标利率为 3.4184%，全场倍数为 4.05 倍，边际倍数为 27.21 倍。今日国债期货早盘下行后低位震荡，下午 14:00 后大幅上行。10 年期国债期货主力合约 T2206 收报 100.220，较上个交易日上涨 0.54%；5 年期国债期货主力合约 TF2206 收报 101.660，较上个交易日上涨 0.39%；2 年期国债期货主力合约 TS2206 收报 101.250，较上个交易日上涨 0.15%。今日现券收益率上午窄幅震荡，午后大幅下行，截至目前，剩余期限 9.51 年的国开债活跃券 210215 收益率报 3.1075%/3.105%，剩余期限 9.69 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.7925%/2.7925%。

周五美元兑人民币中间价报 6.3306，较上个交易日上调 201 点。今日在岸美元兑人民币早盘震荡上行，午后迅速回落转跌，尾盘再度回升，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3228，较上一交易日升值 12 个基点；离岸美元兑人民币冲高回落，下午 16:00 后再度回升，现报 6.3320，较上一交易日升值 37 个基点，目前两岸汇差在 92 个基点附近。美元指数早盘低位反弹，后震荡，欧洲市场开盘后快速上行，现报 98.67，较上一交易日上涨 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