



【2021-12-21】

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 利率非跨年期限下行，跨年期限上行，其中隔夜品种报 1.8580%，下跌 13.60 个基点；7 天品种报 2.0870%，下跌 3.40 个基点；1 个月品种报 2.3860%，上涨 0.50 个基点；3 个月品种报 2.4930%，上涨 0.10 个基点。今日资金整体均衡，国股大行有少量融出，尾盘资金面略有转松。

今日国债期货上午低开后冲高回落低位震荡，下午 14:00 后触底震荡回升，最终收涨。10 年期国债期货主力合约 T2203 收报 100.100，较上个交易日上涨 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF2203 收报 101.235，较上个交易日上涨 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2203 收报 100.850，与上个交易日基本持平。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 3.092%/3.0915%，剩余期限 9.91 年的国债活跃券 210017 收益率报 2.852%/2.85%。

周二美元兑人民币中间价报 6.3729，较上个交易日下调 204 点。今日在岸美元兑人民币上午低开后小幅回升并震荡，午后震荡下行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3707，较上一交易日贬值 74 个基点；离岸美元兑人民币上午震荡，午后快速下行后低位震荡，现报 6.3775，较上一交易日贬值 60 个基点，目前两岸汇差在 68 个基点附近。美元指数上午从低位震荡回升转涨，下午 14:00 后大幅跳水转跌，现报 96.36，较上个交易日下跌 0.16%。

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