

# 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

【2024-11-18】

今日央行开展 1726 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1337 亿，逆回购口径资金净投放 389 亿，此外有国库现金定存操作 1200 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.4700%，上行 0.00 个基点；7 天品种报 1.6970%，上行 1.20 个基点；1 个月品种报 1.7940%，下行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.8560%，上行 0.00 个基点。今日资金面整体均衡稍紧，尾盘趋于均衡偏松，短期限资金价格上行。

下午发行的 182 天期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.2938%、1.7157%、1.8302%，全场倍数分别为 4.70 倍、2.92 倍、3.48 倍，边际倍数分别为 3.09 倍、1.24 倍、1.76 倍。国债期货弱势震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.930，较上个交易日下跌 1.10%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.550，较上个交易日下跌 0.19%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 105.165，较上个交易日下跌 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.630，较上个交易日下跌 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率上行，长端上行幅度较大，截至目前，剩余期限 9.66 年的国开债活跃券 240215 收益率报 2.1725%/2.1690%，剩余期限 9.52 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1125%/2.1100%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1907，较上个交易日下调 85 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡走升，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2441，较上一交易日上涨 131 基点；美元兑离岸人民币现报 7.2522，较上一交易日上涨 161 个基点，目前两岸汇差在 60 个基点附近。美元指数窄幅震荡，现报 106.66，较上一交易日下跌 0.13%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，11 月 15 日当周三大人民币汇率指数全线上行，CFETS 人民币汇率指数报 100.05，环比上行 0.49；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.97，环比上行 0.51；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.02，环比上行 0.19。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui