

# 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

【2024-12-06】

今日央行开展 1909 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4790 亿，逆回购口径资金净回笼 2881 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.4780%，下行 0.10 个基点；7 天品种报 1.6860%，下行 0.20 个基点；1 个月品种报 1.7110%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.7550%，下行 0.70 个基点。今日资金面日内持续均衡偏紧。

今日发行的 1 年期、2 年期进出债中标收益率分别为 1.2325%、1.4200%，全场倍数分别为 3.08 倍、2.77 倍，边际倍数分别为 1.73 倍、1.67 倍；30 年期付息国债中标收益率为 2.1721%，全场倍数分别为 2.98 倍，边际倍数为 3.87 倍。国债期货全天震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 115.380，较上个交易日下跌 0.40%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 107.550，较上个交易日下跌 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 105.800，较上个交易日下跌 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.736，较上个交易日下跌 0.02%。债券市场交投活跃，现券收益率先下后上，午后回升，截至目前，剩余期限 9.62 年的国开债活跃券 240215 收益率报 2.0310%/2.0300%，剩余期限 9.47 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.9575%/1.9550%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1848，较上个交易日下调 31 点。今日美元兑在岸、离岸人民币持续震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2582，较上一交易日下跌 28 基点；美元兑离岸人民币现报 7.2701，较上一交易日上涨 68 个基点，目前两岸汇差在 69 个基点附近。美元指数全天震荡，现报 105.82，较上一交易日上涨 0.10%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui