

# 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

【2025-01-06】

今日央行开展 141 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 891 亿，逆回购口径资金净回笼 750 亿。Shibor 利率全线下跌，其中隔夜品种报 1.4540%，下行 16.40 个基点；7 天品种报 1.5960%，下行 7.40 个基点；1 个月品种报 1.6460%，下行 2.40 个基点；3 个月品种报 1.6630%，下行 1.40 个基点。今日资金面整体偏松，短期限资金价格下行。

下午发行的 1 年期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 0.9760%、1.3200%、1.4000%，全场倍数分别为 3.62 倍、3.73 倍、3.32 倍，边际倍数分别为 1.67 倍、4.79 倍、4.75 倍。国债期货早盘下行后走势分化，主力合约涨跌互现。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 120.680，较上个交易日上涨 0.60%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 109.470，较上个交易日上涨 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.850，较上个交易日下跌 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 103.092，较上个交易日下跌 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡，长端小幅下行，截至目前，剩余期限 9.53 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.6400%/1.6350%，剩余期限 9.38 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.5925%/1.5880%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1876，较上个交易日下调 2 点。今日美元兑在岸、离岸人民币维持震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.3296，较上一交易日上涨 203 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.3497，较上一交易日下跌 86 个基点，目前两岸汇差在 200 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 108.51，较上一交易日下跌 0.38%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui