

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

【2024-12-09】

今日央行开展 471 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 333 亿，逆回购口径资金净投放 138 亿。Shibor 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 1.5160%，上行 3.80 个基点；7 天品种报 1.7360%，上行 5.00 个基点；1 个月品种报 1.7100%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.7530%，下行 0.20 个基点。今日资金面日内紧张，尾盘边际稍有改善，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 1.2211%、1.4288%、1.5361%，全场倍数分别为 10.75 倍、4.15 倍、4.73 倍，边际倍数分别为 1.81 倍、2.50 倍、3.52 倍。国债期货全天震荡，主力合约涨跌互现。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 115.430，较上个交易日上涨 0.13%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 107.515，较上个交易日上涨 0.00%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 105.740，较上个交易日下跌 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.704，较上个交易日下跌 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率维持震荡，政治局会议公报后，收益率快速下行，截至目前，剩余期限 9.61 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.9900%/1.9850%，剩余期限 9.46 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.9140%/1.9100%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1870，较上个交易日上调 22 点。今日美元兑在岸、离岸人民币先上后下，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2760，较上一交易日上涨 178 基点；美元兑离岸人民币现报 7.2829，较上一交易日下跌 11 个基点，目前两岸汇差在 70 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 106.01，较上一交易日上涨 0.04%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，12 月 6 日当周三大人民币汇率指数全线下行，CFETS 人民币汇率指数报 99.71，环比下行 0.36；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.48，环比下行 0.26；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.74，环比下行 0.14。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui