

# 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

【2024-12-20】

今日央行开展 1016 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2051 亿，逆回购口径资金净回笼 1035 亿。Shibor 利率全线下行，其中隔夜品种报 1.4140%，下行 1.00 个基点；7 天品种报 1.6200%，下行 0.70 个基点；1 个月品种报 1.7000%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.7080%，下行 0.40 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格下行。

国债期货震荡上行，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 118.400，较上个交易日上涨 1.14%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 108.895，较上个交易日上涨 0.40%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.705，较上个交易日上涨 0.28%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 103.066，较上个交易日上涨 0.11%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，短端下行幅度较大，截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.7600%/1.7500%，剩余期限 9.43 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.7000%/1.6900%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1901，较上个交易日下调 10 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏弱，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2985，较上一交易日下跌 7 基点；美元兑离岸人民币现报 7.3056，较上一交易日下跌 34 个基点，目前两岸汇差在 70 个基点附近。美元指数午后走弱，现报 108.11，较上一交易日下跌 0.28%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui