

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

【2024-12-23】

今日央行开展 1096 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 7531 亿，逆回购口径资金净回笼 6435 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.3100%，下行 10.40 个基点；7 天品种报 1.5250%，下行 9.50 个基点；1 个月品种报 1.6990%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.7050%，下行 0.30 个基点。今日资金面均衡偏松，短期限资金价格下行。

国债期货高开低走，午后弱势震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 118.090，较上个交易日下跌 0.13%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 108.755，较上个交易日下跌 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.590，较上个交易日下跌 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 103.016，较上个交易日下跌 0.05%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘下行，随后震荡回升，截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.7700%/1.7600%，剩余期限 9.42 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.6975%/1.6925%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1870，较上个交易日下调 31 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏强，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2988，较上一交易日上涨 3 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.3116，较上一交易日上涨 191 个基点，目前两岸汇差在 130 个基点附近。美元指数午后拉升，现报 107.97，较上一交易日上涨 0.12%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，12 月 20 日当周三人民币汇率指数全线上行，CFETS 人民币汇率指数报 101.14，环比上行 0.83；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 107.05，环比上行 0.98；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.70，环比上行 0.61。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui