

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

【2025-01-27】

今日央行开展 2980 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1230 亿，逆回购口径资金净投放 1750 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7080%，上行 3.90 个基点；7 天品种报 1.7150%，下行 14.90 个基点；1 个月品种报 1.7060%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.7020%，上行 0.25 个基点。今日资金面均衡偏松。

国债期货全天窄幅震荡，主力合约全线上涨。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 121.240，较上个交易日上涨 0.74%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 109.340，较上个交易日上涨 0.27%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.590，较上个交易日上涨 0.21%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.832，较上个交易日上涨 0.11%。债券市场交投活跃，现券收益率小幅下行，截至目前，剩余期限 9.47 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.6500%/1.6425%，剩余期限 9.32 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.6190%/1.6150%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1698，较上个交易日下调 7 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡上行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2650，较上一交易日上涨 238 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2722，较上一交易日上涨 279 个基点，目前两岸汇差在 60 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 107.58，较上一交易日上涨 0.11%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui