

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

【2024-12-24】

今日央行开展 641 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3554 亿，逆回购口径资金净回笼 2913 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.3210%，上行 1.10 个基点；7 天品种报 1.4890%，下行 3.60 个基点；1 个月品种报 1.6950%，下行 0.40 个基点；3 个月品种报 1.6985%，下行 0.65 个基点。今日资金面早盘均衡偏松，日内有所收敛，尾盘维持均衡，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的 28 天期、91 天期、1 年期、7 年期国债中标收益率分别为 0.3521%、0.5060%、0.6612%、1.4900%，边际收益率分别为 0.4173%、0.5462%、0.7512%、1.5300%，全场倍数分别为 3.97 倍、3.30 倍、3.00 倍、4.13 倍，边际倍数分别为 4.01 倍、2.26 倍、2.85 倍、2.55 倍。国债期货早盘震荡偏强，临近午盘转为下行，午后弱势震荡，主力合约多数收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 117.450，较上个交易日下跌 0.62%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 108.700，较上个交易日下跌 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.520，较上个交易日下跌 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 103.036，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，长端现券收益率先下后上，截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.7925%/1.7900%，剩余期限 9.42 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.7200%/1.7150%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1876，较上个交易日上调 6 点。今日美元兑在岸、离岸人民币窄幅震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2987，较上一交易日下跌 1 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.3067，较上一交易日下跌 12 个基点，目前两岸汇差在 80 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 108.14，较上一交易日上涨 0.05%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui