

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

【2024-12-27】

今日央行开展 1078 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1016 亿，逆回购口径资金净投放 62 亿。Shibor 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 1.3880%，上行 0.20 个基点；7 天品种报 1.7400%，上行 20.70 个基点；1 个月品种报 1.6860%，下行 0.30 个基点；3 个月品种报 1.6900%，下行 0.22 个基点。今日资金面整体均衡偏松，隔夜期限资金价格下行。

国债期货全天震荡走升，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 118.530，较上个交易日上涨 1.20%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 108.860，较上个交易日上涨 0.37%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.565，较上个交易日上涨 0.24%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 103.008，较上个交易日上涨 0.10%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，长端下行，截至目前，剩余期限 9.56 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.7550%/1.7500%，剩余期限 9.41 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.6900%/1.6750%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1893，较上个交易日下调 4 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 7.2992，较上一交易日上涨 3 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.3090，较上一交易日上涨 59 个基点，目前两岸汇差在 100 个基点附近。美元指数午后回落，现报 108.08，较上一交易日下跌 0.01%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui