

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

【2024-12-04】

今日央行开展 413 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2683 亿，逆回购口径资金净回笼 2270 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.3810%，上行 4.40 个基点；7 天品种报 1.5880%，下行 1.30 个基点；1 个月品种报 1.7160%，下行 2.00 个基点；3 个月品种报 1.7720%，下行 2.30 个基点。今日资金面日内均衡偏紧，尾盘转为均衡，短期限资金价格小幅上行。

上午发行的 5 年期国债中标收益率为 1.5488%，边际收益率为 1.5724%，全场倍数为 4.63 倍，边际倍数为 8.01 倍；下午发行的 1.0548 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.0048%、2.0047%，全场倍数分别为 3.66 倍、3.61 倍，边际倍数分别为 2.80 倍、5.69 倍。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 115.790，较上个交易日上涨 0.70%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 107.580，较上个交易日上涨 0.27%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 105.820，较上个交易日上涨 0.16%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.774，较上个交易日上涨 0.07%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.62 年的国开债活跃券 240215 收益率报 2.0375%/2.0325%，剩余期限 9.47 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.9575%/1.9525%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1934，较上个交易日下调 62 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡下行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2688，较上一交易日下跌 103 基点；美元兑离岸人民币现报 7.2818，较上一交易日下跌 180 个基点，目前两岸汇差在 110 个基点附近。美元指数维持震荡，现报 106.46，较上一交易日上涨 0.12%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui