

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

【2024-12-19】

今日央行开展 806 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 661 亿，逆回购口径资金净投放 145 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.4240%，下行 0.40 个基点；7 天品种报 1.6270%，下行 14.90 个基点；1 个月品种报 1.7010%，下行 0.30 个基点；3 个月品种报 1.7120%，下行 0.30 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格下行。

上午发行的 1 年期、2 年期、3 年期进出债中标收益率分别为 1.1522%、1.2300%、1.2788%，全场倍数分别为 3.66 倍、5.06 倍、5.26 倍，边际倍数分别为 2.48 倍、3.48 倍、3.29 倍。国债期货早盘冲高回落，午后维持震荡，主力合约涨跌互现。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 117.140，较上个交易日下跌 0.25%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 108.535，较上个交易日上涨 0.11%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.445，较上个交易日上涨 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.972，较上个交易日上涨 0.08%。债券市场交投活跃，现券收益率先下后上，午后再度下行，截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.8100%/1.8050%，剩余期限 9.43 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.7375%/1.7350%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1911，较上个交易日上调 31 点。今日美元兑在岸、离岸人民币维持震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2992，较上一交易日上涨 136 基点；美元兑离岸人民币现报 7.3120，较上一交易日下跌 127 个基点，目前两岸汇差在 130 个基点附近。美元指数弱势震荡，现报 108.08，较上一交易日下跌 0.17%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui