

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

【2025-01-03】

今日央行开展 193 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1078 亿，逆回购口径资金净回笼 885 亿。Shibor 利率多数下跌，其中隔夜品种报 1.6180%，上行 8.60 个基点；7 天品种报 1.6700%，上行 2.70 个基点；1 个月品种报 1.6700%，下行 0.60 个基点；3 个月品种报 1.6770%，下行 0.55 个基点。今日资金面早盘偏紧，随后快速趋松，午后延续宽松态势，短期限资金价格波动。

上午发行的 1 年期、2 年期、3 年期、5 年期进出债中标收益率分别为 1.0198%、1.2497%、1.2939%、1.3780%，全场倍数分别为 2.35 倍、3.07 倍、3.95 倍、4.61 倍，边际倍数分别为 1.06 倍、1.00 倍、1.12 倍、3.50 倍；下午发行的 1 年期、5 年期国开债中标收益率分别为 1.1000%、1.2700%，全场倍数分别为 2.34 倍、3.63 倍，边际倍数分别为 5.89 倍、4.17 倍。国债期货全天震荡，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 120.160，较上个交易日上涨 0.22%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 109.440，较上个交易日上涨 0.22%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.970，较上个交易日上涨 0.33%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 103.148，较上个交易日上涨 0.15%。债券市场交投活跃，现券收益率中端下行明显，长端小幅下行，截至目前，剩余期限 9.54 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.6450%/1.6425%，剩余期限 9.39 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.5975%/1.5900%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1878，较上个交易日下调 1 点。今日美元兑在岸、离岸人民币午后走高，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.3093，较上一交易日上涨 99 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.3570，较上一交易日上涨 167 个基点，目前两岸汇差在 430 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 109.11，较上一交易日下跌 0.11%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui