

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

【2025-01-15】

今日央行开展 9595 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 11 亿，此外有 9950 亿 MLF 到期，全口径资金净回笼 366 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.8320%，下行 13.30 个基点；7 天品种报 2.1170%，下行 4.50 个基点；1 个月品种报 1.6680%，上行 0.60 个基点；3 个月品种报 1.6665%，上行 0.85 个基点。今日资金面整体紧张，短期限资金价格维持波动。

上午发行的 91 天期、182 天期国债中标收益率分别为 1.2997%、1.3223%，边际收益率分别为 1.4007%、1.4137%，全场倍数分别为 2.10 倍、2.27 倍，边际倍数分别为 3.12 倍、4.28 倍；下午发行的 1.074 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.3171%、1.6876%，全场倍数分别为 2.23 倍、2.55 倍，边际倍数分别为 40.00 倍、3.33 倍。国债期货全天震荡，主力合约多数收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 120.600，较上个交易日上涨 0.61%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 109.320，较上个交易日上涨 0.20%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.525，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.828，较上个交易日下跌 0.00%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘震荡，午后震荡上行，截至目前，剩余期限 9.51 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.6500%/1.6430%，剩余期限 9.36 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.6175%/1.6100%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1883，较上个交易日上调 5 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 7.3319，较上一交易日上涨 16 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.3480，较上一交易日上涨 36 个基点，目前两岸汇差在 160 个基点附近。美元指数早盘震荡，午后先下后上，现报 109.20，较上一交易日上涨 0.01%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui