

# 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

【2024-09-25】

今日央行开展 1965 亿 14 天期逆回购操作，3000 亿 1 年期 MLF 操作，MLF 中标利率 2.0%，较上次下降 30BP，逆回购到期 5682 亿，全口径资金净回笼 717 亿。Shibor 利率全线下行，其中隔夜品种报 1.6430%，下行 14.20 个基点；7 天品种报 1.8730%，下行 4.70 个基点；1 个月品种报 1.8300%，下行 0.60 个基点；3 个月品种报 1.8450%，下行 0.50 个基点。今日资金面整体均衡偏紧，短期限资金价格下行。

下午发行的 1 年期、1.05 年期、3 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.4065%、1.4800%、1.9937%、2.0900%，全场倍数分别为 2.04 倍、3.37 倍、2.68 倍、2.43 倍，边际倍数分别为 1.31 倍、2.00 倍、2.31 倍、2.17 倍。国债期货震荡走升，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 114.850，较上个交易日上涨 0.31%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.950，较上个交易日上涨 0.29%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 105.375，较上个交易日上涨 0.29%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.506，较上个交易日上涨 0.14%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘上行，随后震荡下行，5Y 期收益率下行明显，截至目前，剩余期限 9.61 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1100%/2.1075%，剩余期限 9.66 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.0380%/2.0360%。

周三美元兑人民币中间价报 7.0202，较上个交易日下调 308 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 7.0218，较上一交易日下跌 167 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0201，较上一交易日上涨 91 个基点，目前两岸汇差倒挂在 30 个基点附近。美元指数震荡回升，现报 100.44，较上一交易日上涨 0.08%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui