

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

【2024-11-25】

今日央行开展 2493 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1726 亿，逆回购口径资金净投放 767 亿，此外开展了 9000 亿 1 年期 MLF 操作。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.4640%，上行 0.80 个基点；7 天品种报 1.7270%，上行 7.40 个基点；1 个月品种报 1.7870%，下行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.8600%，上行 0.00 个基点。今日资金面早盘均衡，尾盘趋于偏松，隔夜期限资金价格上行。

下午发行的 182 天期、3 年期[24 农发 13(增 16)]、3 年期[24 农发绿债 02(增发)]、5 年期农发债中标收益率分别为 1.2486%、1.6765%、1.4560%、1.7983%，全场倍数分别为 4.74 倍、3.63 倍、2.71 倍、3.41 倍，边际倍数分别为 3.75 倍、1.98 倍、1.16 倍、1.43 倍。国债期货震荡偏强，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 114.100，较上个交易日上涨 0.67%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 107.095，较上个交易日上涨 0.17%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 105.515，较上个交易日上涨 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.630，较上个交易日上涨 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，长端下行幅度大于短端，截至目前，剩余期限 9.65 年的国开债活跃券 240215 收益率报 2.1350%/2.1335%，剩余期限 9.50 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.0645%/2.0630%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1918，较上个交易日下调 24 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2462，较上一交易日上涨 10 基点；美元兑离岸人民币现报 7.2558，较上一交易日下跌 39 个基点，目前两岸汇差在 100 个基点附近。美元指数午后震荡上行，现报 107.21，较上一交易日下跌 0.26%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，11 月 22 日当周三大人民币汇率指数全线上行，CFETS 人民币汇率指数报 100.06，环比上行 0.01；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.98，环比上行 0.01；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.21，环比上行 0.19。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui