



【2024-12-31】

今日央行开展 1577 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 641 亿，逆回购口径资金净投放 936 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.4540%，上行 8.70 个基点；7 天品种报 1.9660%，上行 1.600 个基点；1 个月品种报 1.6810%，下行 0.36 个基点；3 个月品种报 1.6855%，上行 0.05 个基点。今日资金面日内紧张，尾盘转为均衡偏松，短期限资金价格上行。

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 118.830，较上个交易日上涨 0.79%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 108.925，较上个交易日上涨 0.31%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.540，较上个交易日上涨 0.18%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.974，较上个交易日上涨 0.07%。债券市场交投活跃，现券收益率长端下行，截至目前，剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.7350%/1.7330%，剩余期限 9.40 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.6700%/1.6675%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1884，较上个交易日下调 5 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 7.2988，较上一交易日下跌 4 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.3245，较上一交易日上涨 99 个基点，目前两岸汇差在 250 个基点附近。美元指数全天震荡，现报 107.96，较上一交易日下跌 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui