



【2024-09-30】

今日央行开展 2121 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1601 亿，全口径资金净投放 520 亿。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 1.5140%，上行 17.80 个基点；7 天品种报 1.5220%，下行 20.50 个基点；1 个月品种报 1.8200%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.8400%，上行 0.40 个基点。今日资金面整体均衡偏松，平稳跨季。

国债期货低开震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 110.310，较上个交易日下跌 0.53%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.365，较上个交易日下跌 0.24%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.505，较上个交易日下跌 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.310，较上个交易日下跌 0.00%。债券市场交投活跃，现券收益率明显下行，截至目前，剩余期限 9.60 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2425%/2.2375%，剩余期限 9.65 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1625%/2.1450%。

周一美元兑人民币中间价报 7.0074，较上个交易日下调 27 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 7.0156，较上一交易日下跌 4 基点；美元兑离岸人民币现报 6.9964，较上一交易日上涨 146 个基点，目前两岸汇差倒挂在 160 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 100.27，较上一交易日下跌 0.15%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui