



【2024-12-13】

今日央行开展 2051 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1909 亿，逆回购口径资金净投放 142 亿。Shibor 利率多数下跌，其中隔夜品种报 1.4040%，下行 7.80 个基点；7 天品种报 1.7580%，上行 12.30 个基点；1 个月品种报 1.7100%，下行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.7350%，下行 0.50 个基点。今日资金面整体均衡偏紧，尾盘趋于均衡，隔夜期限资金价格小幅下行。

上午发行的 2 年期国债中标收益率 1.0600%，边际收益率为 1.1000%，全场倍数为 3.51 倍，边际倍数为 1.93 倍；发行的 1 年期、2 年期进出债中标收益率分别为 1.1784%、1.2642%，全场倍数分别为 3.54 倍、5.47 倍，边际倍数分别为 2.80 倍、2.99 倍。国债期货全天震荡偏强，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 117.750，较上个交易日上涨 0.60%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 108.490，较上个交易日上涨 0.24%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.380，较上个交易日上涨 0.16%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.876，较上个交易日上涨 0.02%。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 240215 收益率报 1.8440%/1.8425%，剩余期限 9.45 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.7750%/1.7710%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1876，较上个交易日上调 22 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡上升，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2795，较上一交易日上涨 165 基点；美元兑离岸人民币现报 7.2892，较上一交易日上涨 139 个基点，目前两岸汇差在 80 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 107.09，较上一交易日上涨 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui