



【2024-12-12】

今日央行开展 661 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 373 亿，逆回购口径资金净投放 288 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.4820%，下行 4.60 个基点；7 天品种报 1.6350%，下行 8.70 个基点；1 个月品种报 1.7120%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.7400%，下行 0.40 个基点。今日资金面整体均衡偏紧，尾盘趋于均衡，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.2696%、1.4636%、1.8013%，全场倍数分别为 5.44 倍、4.68 倍、3.70 倍，边际倍数分别为 1.19 倍、1.00 倍、6.80 倍。国债期货全天震荡偏强，主力合约全线小幅收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 117.090，较上个交易日上涨 0.10%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 108.280，较上个交易日上涨 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.245，较上个交易日上涨 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.870，较上个交易日上涨 0.07%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，整体有所下行，截至目前，剩余期限 9.60 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.8850%/1.8800%，剩余期限 9.45 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.8125%/1.8100%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1854，较上个交易日上调 11 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 7.2630，较上一交易日上涨 40 基点；美元兑离岸人民币现报 7.2631，较上一交易日下跌 168 个基点，目前两岸汇差在 5 个基点附近。美元指数弱势震荡，现报 106.55，较上一交易日下跌 0.08%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui