



【2024-10-11】

今日央行开展 942 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2780 亿，全口径资金净回笼 1838 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.4060%，下行 12.10 个基点；7 天品种报 1.5260%，下行 17.40 个基点；1 个月品种报 1.8200%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.8410%，上行 0.00 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格下行。

上午发行的 1 年期、2 年期进出债中标收益率分别为 1.4444%、1.6552%，全场倍数分别为 3.54 倍、5.05 倍，边际倍数分别为 3.32 倍、2.50 倍；发行的 30 年期特别国债中标收益率为 2.2987%，全场倍数为 2.37 倍，边际倍数为 1.27 倍；下午发行的 2 年期、5 年期国开债中标收益率分别为 1.6495%、1.7472%，全场倍数分别为 2.51 倍、3.23 倍，边际倍数分别为 2.57 倍、1.52 倍。国债期货全天震荡，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 112.450，较上个交易日上涨 0.03%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.910，较上个交易日上涨 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.760，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.326，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，短端下行，长端小幅上行，截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2250%/2.2200%，剩余期限 9.62 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1325%/2.1300%。

周五美元兑人民币中间价报 7.0731，较上个交易日下调 11 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏弱，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.0676，较上一交易日下跌 111 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0732，较上一交易日下跌 99 个基点，目前两岸汇差在 50 个基点附近。美元指数维持震荡，现报 102.78，较上一交易日下跌 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui