



【2024-12-30】

今日央行开展 891 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1096 亿，逆回购口径资金净回笼 205 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.3670%，下行 2.10 个基点；7 天品种报 1.9500%，上行 21.00 个基点；1 个月品种报 1.6846%，下行 0.14 个基点；3 个月品种报 1.6850%，下行 0.50 个基点。今日资金面早盘偏紧，午后趋于改善，尾盘均衡，短期限资金价格维持波动。

国债期货弱势震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2503 收报 118.010，较上个交易日下跌 0.31%；10 年期国债期货主力合约 T2503 收报 108.595，较上个交易日下跌 0.23%；5 年期国债期货主力合约 TF2503 收报 106.350，较上个交易日下跌 0.19%；2 年期国债期货主力合约 TS2503 收报 102.910，较上个交易日下跌 0.08%。债券市场交投活跃，现券收益率窄幅震荡，长端小幅上行，截至目前，剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 240215 收益率报 1.7700%/1.7625%，剩余期限 9.40 年的国债活跃券 240011 收益率报 1.6975%/1.6950%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1889，较上个交易日下调 4 点。今日美元兑在岸、离岸人民币窄幅震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2992，较上一交易日持平；美元兑离岸人民币现报 7.3106，较上一交易日上涨 99 个基点，目前两岸汇差在 110 个基点附近。美元指数全天震荡，现报 108.06，较上一交易日上涨 0.04%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，12 月 27 日当周三大人民币汇率指数全线下行，CFETS 人民币汇率指数报 101.01，环比下行 0.13；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 107.02，环比下行 0.03；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.57，环比下行 0.13。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui