



【2024-10-31】

今日央行开展 3276 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 7989 亿，资金净回笼 4713 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.3640%，下行 3.00 个基点；7 天品种报 1.6560%，上行 0.00 个基点；1 个月品种报 1.8200%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.8840%，上行 0.00 个基点。今日资金面整体均衡偏松，市场平稳跨月，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 3 年期、7 年期国开清发债中标收益率分别为 1.7540%、2.0944%，全场倍数分别为 2.76 倍、2.12 倍，边际倍数分别为 1.14 倍、3.78 倍；发行的 3 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.7756%、2.2440%，全场倍数分别为 3.67 倍、2.77 倍，边际倍数分别为 4.00 倍、1.34 倍；下午发行的 3 年期、5 年期国开债中标收益率分别为 1.8627%、1.7752%，全场倍数分别为 4.98 倍、2.77 倍，边际倍数分别为 1.75 倍、1.58 倍。国债期货震荡走升，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.570，较上个交易日上涨 0.20%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.950，较上个交易日上涨 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.700，较上个交易日上涨 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.462，较上个交易日上涨 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.51 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2130%/2.2100%，剩余期限 9.54 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1275%/2.1225%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1250，较上个交易日下调 140 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 7.1160，较上一交易日下跌 62 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1245，较上一交易日下跌 8 个基点，目前两岸汇差在 60 个基点附近。美元指数震荡走弱，现报 103.97，较上一交易日下跌 0.14%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui