



【2024-08-27】

今日央行开展 4725 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1491 亿，全口径资金净投放 3234 亿。Shibor 利率短端下行，长端上行，其中隔夜品种报 1.6670%，下行 19.50 个基点；7 天品种报 1.8690%，下行 6.70 个基点；1 个月品种报 1.8240%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8490%，上行 0.40 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 5 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.8793%、2.1970%，全场倍数分别为 2.05 倍、1.98 倍，边际倍数分别为 2.88 倍、1.05 倍；下午发行的 2 年期、7 年期农发清发债中标收益率分别为 1.7801%、2.0657%，全场倍数分别为 3.20 倍、4.69 倍，边际倍数分别为 5.00 倍、1.09 倍；发行的 2 年期农发清发绿债中标收益率为 1.4553%，全场倍数为 3.87 倍、边际倍数为 2.69 倍。国债期货全天震荡下行，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.100，较上个交易日下跌 0.56%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.740，较上个交易日下跌 0.24%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.425，较上个交易日下跌 0.12%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.128，较上个交易日下跌 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率整体上行，截至目前，剩余期限 9.69 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2650%/2.2625%，剩余期限 9.74 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1825%/2.1800%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1249，较上个交易日上调 110 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏强，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1296，较上一交易日上涨 108 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1326，较上一交易日上涨 95 个基点，目前两岸汇差在 30 个基点附近。美元指数全天震荡，现报 100.84，较上一交易日下跌 0.04%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui