



【2024-10-09】

今日央行开展 610 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1965 亿，全口径资金净回笼 1355 亿。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 1.6180%，上行 10.90 个基点；7 天品种报 1.8030%，上行 10.60 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 0.10 个基点。今日资金面早盘偏紧，日内边际改善，尾盘均衡偏松，短期限资金价格上行。

上午发行的 28 天期、182 天期、3 年期、7 年期国债中标收益率分别为 1.1482%、1.4137%、1.6080%、2.0476%，边际收益率分别为 1.3702%、1.5155%、1.6841%、2.0681%，全场倍数分别为 2.44 倍、2.02 倍、2.15 倍、2.84 倍，边际收益率分别为 1.67 倍、3.65 倍、2.74 倍、1.30 倍；下午发行的 1 年期、1.0548 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.6118%、1.7761%、2.2643%，全场倍数分别为 2.55 倍、2.03 倍、1.96 倍，边际倍数分别为 1.21 倍、21.00 倍、4.37 倍。国债期货全天震荡，主力合约多数收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.700，较上个交易日上涨 0.81%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.610，较上个交易日上涨 0.20%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.480，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.238，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，短端有所上行，长端有所下行，截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2600%/2.2550%，剩余期限 9.62 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1675%/2.1600%。

周三美元兑人民币中间价报 7.0568，较上个交易日下调 141 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 7.0673，较上一交易日上涨 138 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0757，较上一交易日上涨 17 个基点，目前两岸汇差在 60 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 102.71，较上一交易日上涨 0.25%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui