市场概述
每日市场动态

常规报告系列

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-10-15】

今日央行开展 683 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 417 亿，全口径资金净投放 266 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.4070%，下行 1.10 个基点；7 天品种报 1.5170%，上行 7.00 个基点；1 个月品种报 1.8200%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.8420%，上行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡偏松，尾盘趋于均衡，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 2 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.6001%、2.1392%，全场倍数分别为 3.08 倍、3.31 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、1.20 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 1.6508%、2.0545%，全场倍数分别为 4.66 倍、4.58 倍，边际倍数分别为 1.07 倍、1.46 倍。国债期货早盘震荡偏弱，午后走强，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 112.610，较上个交易日上涨 0.42%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.185，较上个交易日上涨 0.25%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.855，较上个交易日上涨 0.12%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.362，较上个交易日上涨 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘窄幅震荡，午后长端震荡下行，截至目前，剩余期限 9.56 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2045%/2.1975%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1200%/2.1175%。

周二美元兑人民币中间价报 7.0830，较上个交易日上调 107 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡上行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1147，较上一交易日上涨 352 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1266，较上一交易日上涨 309 个基点，目前两岸汇差在 120 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 103.12，较上一交易日下跌 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui