

# 市场概述 每日市场动态

常规报告系列



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

【2024-09-12】

今日央行开展 1608 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 633 亿，全口径资金净投放 975 亿。Shibor 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 1.7770%，上行 0.40 个基点；7 天品种报 1.7940%，上行 1.80 个基点；1 个月品种报 1.8300%，下行 0.40 个基点；3 个月品种报 1.8500%，下行 0.10 个基点。今日资金面整体均衡稍紧，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 1.6701%、1.9706%，全场倍数分别为 3.71 倍、3.32 倍，边际倍数分别为 6.35 倍、5.60 倍；发行的 3 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.6700%、2.1288%，全场倍数分别为 4.49 倍、5.90 倍，边际倍数分别为 1.27 倍、1.18 倍；下午发行的 3 年期、5 年期国开债中标收益率分别为 1.8142%、1.7549%，全场倍数分别为 4.89 倍、3.85 倍，边际倍数分别为 1.38 倍、1.77 倍。国债期货维持震荡，主力合约涨跌互现。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 113.590，较上个交易日上涨 0.11%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.635，较上个交易日下跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 105.110，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.418，较上个交易日下跌 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率长端下行，截至目前，剩余期限 9.65 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1800%/2.1775%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.0950%/2.0930%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1214，较上个交易日上调 32 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1236，较上一交易日上涨 105 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1290，较上一交易日下跌 6 个基点，目前两岸汇差在 80 个基点附近。美元指数窄幅震荡，现报 101.71，较上一交易日下跌 0.03%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui