



【2024-08-15】

今日央行开展 5777 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 71 亿，MLF 到期 4010 亿，全口径资金净投放 1696 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.7540%，下行 8.80 个基点；7 天品种报 1.8140%，下行 5.50 个基点；1 个月品种报 1.8110%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8400%，上行 0.20 个基点。今日资金面整体均衡附近波动，隔夜期限资金价格下行。

上午发行的 3 年期、7 年期国开清发债中标收益率分别为 1.7769%、2.0287%，全场倍数分别为 2.12 倍、2.42 倍，边际倍数分别为 37.57 倍、1.34 倍；发行的 3 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.7109%、2.1700%，全场倍数分别为 6.61 倍、4.75 倍，边际倍数分别为 7.78 倍、2.08 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.8588%、2.2069%，全场倍数分别为 3.78 倍、2.35 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、2.51 倍。国债期货震荡高开低走，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 111.080，较上个交易日下跌 0.34%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.545，较上个交易日下跌 0.16%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.250，较上个交易日下跌 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 102.052，较上个交易日下跌 0.06%。债券市场交投活跃，现券收益率午后上行，国开-国债利差扩大，截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2500%/2.2400%，剩余期限 9.78 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1925%/2.1900%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1399，较上个交易日下调 16 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 7.1611，较上一交易日上涨 127 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1604，较上一交易日下跌 133 个基点，目前两岸汇差在 10 个基点附近。美元指数维持震荡，现报 102.62，较上一交易日上涨 0.01%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui