

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

【2024-07-15】

今日央行开展 1290 亿 7 天期逆回购、1000 亿 1 年期 MLF 操作，操作利率维持不变，逆回购到期 20 亿，全口径资金净投放 2270 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7800%，上行 11.20 个基点；7 天品种报 1.8210%，上行 2.00 个基点；1 个月品种报 1.8790%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8970%，下行 0.20 个基点。今日资金面早盘均衡，日内边际收敛，短期限资金价格上行。

下午发行的 91 天期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.4492%、1.8479%、1.9824%，全场倍数分别为 5.81 倍、4.32 倍、5.15 倍，边际倍数分别为 1.30 倍、1.17 倍、2.52 倍。国债期货震荡偏强，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 109.080，较上个交易日上涨 0.22%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.340，较上个交易日上涨 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.015，较上个交易日上涨 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.984，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率整体下行，截至目前，剩余期限 9.48 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3340%/2.3310%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2615%/2.2605%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1313，较上个交易日下调 2 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 7.2627，较上一交易日上涨 42 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2744，较上一交易日上涨 22 个基点，目前两岸汇差在 120 个基点附近。美元指数震荡回落，现报 104.12，较上一交易日上涨 0.02%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，7 月 12 日当周三大人民币汇率指数全线下行，CFETS 人民币汇率指数报 99.24，环比下行 0.52；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.29，环比下行 0.55；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.94，环比下行 0.35。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui