

# 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

【2024-10-14】

今日央行开展 195 亿 7 天期逆回购操作，无逆回购到期，全口径资金净投放 195 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.4180%，上行 11.20 个基点；7 天品种报 1.5870%，上行 7.60 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 0.00 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格上行。

上午发行的 2 年期、5 年期国债中标收益率分别为 1.4779%、1.7400%，边际收益率分别为 1.5253%、1.7700%，全场倍数分别为 2.51 倍、2.47 倍，边际倍数分别为 2.72 倍、1.50 倍；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 1.1968%、1.7152%、1.8577%，全场倍数分别为 3.95 倍、3.00 倍、3.40 倍，边际倍数分别为 1.43 倍、8.36 倍、2.28 倍。国债期货早盘震荡偏强，午后走弱，主力合约多数收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 112.270，较上个交易日下跌 0.33%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.935，较上个交易日下跌 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.755，较上个交易日下跌 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.346，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率全天窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.56 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2220%/2.2175%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1300%/2.1250%。

周一美元兑人民币中间价报 7.0723，较上个交易日下调 8 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 7.0795，较上一交易日上涨 119 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0876，较上一交易日上涨 173 个基点，目前两岸汇差在 80 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 103.04，较上一交易日上涨 0.11%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，10 月 11 日当周三大人民币汇率指数全线上行，CFETS 人民币汇率指数报 99.34，环比上涨 0.98；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.24，环比上涨 1.07；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.06，环比上涨 0.31。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui