

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

【2024-09-23】

今日央行开展 1601 亿 7 天期、745 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1387 亿，全口径资金净投放 959 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.9210%，下行 1.10 个基点；7 天品种报 1.8590%，下行 7.00 个基点；1 个月品种报 1.8370%，上行 0.30 个基点；3 个月品种报 1.8540%，上行 0.20 个基点。今日资金面整体均衡，短期限资金价格小幅下行。

下午发行的 91 天期、3 年期[2404002.IB]、3 年期[240413Z9.IB]、5 年期农发债中标收益率分别为 1.2069%、1.4712%、1.6571%、1.7971%，全场倍数分别为 3.39 倍、3.02 倍、3.35 倍、4.01 倍，边际倍数分别为 12.00 倍、1.00 倍、1.49 倍、1.75 倍。国债期货高开低走，主力合约多数收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 115.630，较上个交易日上涨 0.29%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.930，较上个交易日下跌 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 105.170，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.388，较上个交易日下跌 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率中短端小幅上行，长端小幅下行，截至目前，剩余期限 9.62 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1160%/2.1130%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.0350%/2.0335%。

周一美元兑人民币中间价报 7.0531，较上个交易日下调 113 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 7.0587，较上一交易日上涨 35 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0635，较上一交易日上涨 219 个基点，目前两岸汇差在 40 个基点附近。美元指数午后拉升，现报 101.15，较上一交易日上涨 0.42%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，9 月 20 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 97.96，环比上行 0.19；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 103.70，环比上行 0.17；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.08，环比上行 0.25。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui