



【2024-08-16】

今日央行开展 1378 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 129 亿，逆回购口径资金净投放 1249 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.7000%，下行 5.40 个基点；7 天品种报 1.8110%，下行 0.30 个基点；1 个月品种报 1.8090%，下行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.8380%，下行 0.20 个基点。今日资金面早盘均衡偏松，尾盘趋于均衡，隔夜期限资金价格下行。

上午发行的 1 年期、2 年期进出债中标收益率分别为 1.3958%、1.6041%，全场倍数分别为 3.49 倍、7.93 倍，边际倍数分别为 19.55 倍、6.67 倍；发行的 91 天期国债中标收益率为 1.3280%，边际收益率为 1.4169%，全场倍数为 2.50 倍，边际倍数为 1.61 倍；下午发行的 5 年期国开债中标收益率为 1.8952%，全场倍数为 2.04 倍，边际倍数为 1.73 倍。国债期货早盘震荡走升，午后涨幅回落，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 110.680，较上个交易日上涨 0.06%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.655，较上个交易日上涨 0.16%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.360，较上个交易日上涨 0.12%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 102.080，较上个交易日上涨 0.02%。债券市场交投活跃，现券收益率维持震荡，截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2490%/2.2450%，剩余期限 9.77 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1900%/2.1830%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1464，较上个交易日上调 65 点。今日美元兑在岸、离岸人民币维持震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1680，较上一交易日上涨 69 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1722，较上一交易日下跌 70 个基点，目前两岸汇差在 30 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 102.87，较上一交易日下跌 0.18%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui