

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

【2024-07-22】

今日央行开展 582 亿 7 天期逆回购操作，操作利率下行 10BP，逆回购到期 1290 亿，全口径资金净回笼 708 亿。Shibor 利率全线下行，其中隔夜品种报 1.6470%，下行 20.80 个基点；7 天品种报 1.7150%，下行 14.00 个基点；1 个月品种报 1.8730%，下行 0.40 个基点；3 个月品种报 1.8940%，下行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡，日内趋于收敛，短期限资金价格下行。

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 1.3886%、1.8000%、1.9208%，全场倍数分别为 4.31 倍、4.33 倍、4.57 倍，边际倍数分别为 3.00 倍、2.80 倍、1.22 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 109.410，较上个交易日上涨 0.33%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.715，较上个交易日上涨 0.27%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.310，较上个交易日上涨 0.21%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 102.110，较上个交易日上涨 0.08%。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 9.46 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3090%/2.3080%，剩余期限 9.60 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2430%/2.2410%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1335，较上个交易日上调 20 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 7.2737，较上一交易日上涨 65 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2947，较上一交易日上涨 89 个基点，目前两岸汇差在 210 个基点附近。美元指数震荡偏弱，现报 104.26，较上一交易日下跌 0.10%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，7 月 19 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 99.19，环比下行 0.05；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.25，环比下行 0.04；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.67，环比下行 0.27。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui