



【2024-09-06】

今日央行开展 1415 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 301 亿，全口径资金净投放 1114 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7160%，上行 13.80 个基点；7 天品种报 1.6760%，下行 0.40 个基点；1 个月品种报 1.8310%，上行 0.60 个基点；3 个月品种报 1.8500%，上行 0.00 个基点。今日资金面早盘均衡偏紧，尾盘有所改善，隔夜期限资金价格上行。

上午发行的 1 年期、2 年期进出债中标收益率分别为 1.4130%、1.5795%，全场倍数分别为 2.91 倍、5.13 倍，边际倍数分别为 2.50 倍、2.69 倍；发行的 91 天期、182 天期、30 年期国债中标收益率分别为 1.3320%、1.3812%、2.3062%，边际收益率分别为 1.4007%、1.4443%、--%，全场倍数分别为 2.55 倍、2.39 倍、2.63 倍，边际倍数分别为 1.43 倍、1.20 倍、1.32 倍；下午发行的 5 年期国开债中标收益率为 1.8232%，全场倍数为 2.35 倍，边际倍数为 2.68 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 TL2412 收报 112.560，较上个交易日上涨 0.12%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.295，较上个交易日上涨 0.08%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.895，较上个交易日上涨 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.310，较上个交易日上涨 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.66 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2170%/2.2150%，剩余期限 9.72 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1400%/2.1310%。

周五美元兑人民币中间价报 7.0925，较上个交易日下调 64 点。今日美元兑在岸、离岸人民币弱势震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.0882，较上一交易日下跌 113 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0868，较上一交易日下跌 39 个基点，目前两岸汇差倒挂在 10 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 100.94，较上一交易日下跌 0.11%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui