



【2024-08-26】

今日央行开展 4710 亿 7 天期逆回购、3000 亿 MLF 操作，逆回购到期 521 亿，全口径资金净投放 7189 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.8620%，上行 6.10 个基点；7 天品种报 1.9360%，上行 11.10 个基点；1 个月品种报 1.8230%，上行 0.40 个基点；3 个月品种报 1.8450%，上行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡偏紧，日内边际改善，短期限资金价格上行。

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 1.3078%、1.7954%、1.8982%，全场倍数分别为 3.41 倍、3.79 倍、5.58 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、3.33 倍、3.25 倍。国债期货全天震荡偏强，主力合约小幅上涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.750，较上个交易日上涨 0.00%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.000，较上个交易日上涨 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.565，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.174，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 9.69 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2300%/2.2250%，剩余期限 9.75 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1520%/2.1510%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1139，较上个交易日下调 219 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 7.1188，较上一交易日下跌 180 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1167，较上一交易日上涨 6 个基点，目前两岸汇差倒挂在 20 个基点附近。美元指数震荡回升，现报 100.70，较上一交易日上涨 0.01%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，8 月 23 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 97.89，环比下行 0.54；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 103.54，环比下行 0.65；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 92.56，环比下行 0.54。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui