



【2024-09-05】

今日央行开展 633 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1509 亿，全口径资金净回笼 876 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.5780%，上行 4.90 个基点；7 天品种报 1.6800%，上行 1.00 个基点；1 个月品种报 1.8250%，上行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.8500%，上行 0.00 个基点。今日资金面均衡偏紧，隔夜期限资金价格上行。

上午发行的 3 年期、7 年期国开清发债中标收益率分别为 1.7030%、2.0091%，全场倍数分别为 3.74 倍、3.13 倍，边际倍数分别为 1.71 倍、3.00 倍；发行的 3 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.6278%、2.1749%，全场倍数分别为 5.71 倍、5.29 倍，边际倍数分别为 1.82 倍、2.81 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.8774%、2.1669%，全场倍数分别为 4.03 倍、2.70 倍，边际倍数分别为 6.58 倍、1.01 倍。国债期货早盘震荡偏强，午后震荡回落，主力合约涨跌互现。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 112.230，较上个交易日上涨 0.10%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.155，较上个交易日上涨 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.805，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.264，较上个交易日下跌 0.00%。债券市场交投活跃，现券收益率走势分化，长端午后上行，截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2100%/2.2075%，剩余期限 9.72 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1300%/2.1260%。

周四美元兑人民币中间价报 7.0989，较上个交易日下调 159 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 7.0995，较上一交易日下跌 140 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0992，较上一交易日下跌 137 个基点，目前两岸汇差在 0 个基点附近。美元指数震荡走弱，现报 101.16，较上一交易日下跌 0.12%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui