



【2024-07-29】

今日央行开展 3015.7 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 582 亿，全口径资金净投放 2433.7 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.6310%，下行 5.80 个基点；7 天品种报 1.8950%，下行 1.80 个基点；1 个月品种报 1.8430%，下行 0.50 个基点；3 个月品种报 1.8690%，下行 0.80 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格下行。

上午发行的 91 天期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.3583%、1.7744%、1.8990%，全场倍数分别为 3.75 倍、4.81 倍、4.20 倍，边际倍数分别为 1.96 倍、38.33 倍、1.64 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 110.930，较上个交易日上涨 0.52%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.950，较上个交易日上涨 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.430，较上个交易日上涨 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 102.164，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，长端下行幅度较大，截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2260%/2.2230%，剩余期限 9.82 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1575%/2.1560%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1316，较上个交易日上调 46 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 7.2577，较上一交易日上涨 41 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2710，较上一交易日上涨 77 个基点，目前两岸汇差在 140 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 104.53，较上一交易日上涨 0.19%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，7 月 26 日当周三大人民币汇率指数全线上行，CFETS 人民币汇率指数报 99.34，环比上行 0.15；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.41，环比上行 0.16；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.81，环比上行 0.14。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui