

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

【2024-10-16】

今日央行开展 6424 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 610 亿，MLF 到期 7890 亿，全口径资金净回笼 2076 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.4600%，上行 5.30 个基点；7 天品种报 1.5900%，上行 7.30 个基点；1 个月品种报 1.8190%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8460%，上行 0.40 个基点。今日资金面整体均衡，尾盘均衡偏松，短期限资金价格上行。

上午发行的 63 天期、91 天期、50 年期国债中标收益率分别为 1.1943%、1.3284%、2.3252%，边际收益率分别为 1.3123%、1.4492%、--%，全场倍数分别为 2.52 倍、2.00 倍、2.69 倍，边际倍数分别为 1.77 倍、10.00 倍、5.38 倍；发行的 7 年期进出清发中标收益率为 2.0725%，全场倍数为 5.06 倍，边际倍数为 14.00 倍；下午发行的 1.0548 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.5145%、2.1984%，全场倍数分别为 2.49 倍、2.56 倍，边际倍数分别为 1.19 倍、2.12 倍。国债期货震荡下行，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 112.080，较上个交易日下跌 0.24%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.090，较上个交易日下跌 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.770，较上个交易日下跌 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.346，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率整体上行，截至目前，剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2075%/2.2040%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1200%/2.1170%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1191，较上个交易日上调 361 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1150，较上一交易日上涨 3 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1282，较上一交易日下跌 84 个基点，目前两岸汇差在 100 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 103.37，较上一交易日上涨 0.15%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui