

# 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

【2024-08-05】

今日央行开展 6.7 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3015.7 亿，全口径资金净回笼 3009 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.5850%，上行 1.20 个基点；7 天品种报 1.6940%，下行 0.60 个基点；1 个月品种报 1.8180%，下行 0.70 个基点；3 个月品种报 1.8490%，下行 0.40 个基点。今日资金面整体均衡，隔夜期限资金价格小幅上行。

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 1.2977%、1.6951%、1.8269%，全场倍数分别为 4.32 倍、5.10 倍、4.28 倍，边际倍数分别为 21.25 倍、4.15 倍、1.22 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 112.970，较上个交易日上涨 1.14%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 106.550，较上个交易日上涨 0.27%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.755，较上个交易日上涨 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 102.282，较上个交易日上涨 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率日内震荡下行，尾盘反转回升，截至目前，剩余期限 9.75 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1850%/2.1800%，剩余期限 9.81 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1250%/2.1225%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1345，较上个交易日下调 31 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏弱，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1385，较上一交易日下跌 765 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.1282，较上一交易日下跌 376 个基点，目前两岸汇差倒挂在 90 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 102.44，较上一交易日下跌 0.77%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，8 月 2 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 98.95，环比下行 0.39；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.02，环比下行 0.39；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.70，环比下行 0.11。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui