



【2024-09-18】

今日央行开展 5682 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4875 亿，MLF 到期 5910 亿，全口径资金净回笼 5103 亿。Shibor 利率多数上涨，其中隔夜品种报 1.7440%，上行 13.30 个基点；7 天品种报 1.8600%，上行 11.40 个基点；1 个月品种报 1.8310%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8500%，上行 0.00 个基点。今日资金面早盘均衡偏紧，日内边际趋紧，隔夜期限资金价格上行。

上午发行的 1 年期、3 年期、5 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.4342%、1.6707%、1.7813%、2.1061%，全场倍数分别为 2.19 倍、3.63 倍、4.03 倍、2.77 倍，边际倍数分别为 5.65 倍、4.17 倍、1.27 倍、1.53 倍。国债期货维持震荡偏强，主力合约全线上行。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 115.130，较上个交易日上涨 0.89%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.905，较上个交易日上涨 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 105.220，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.444，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，临近尾盘反弹，截至目前，剩余期限 9.63 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1275%/2.1250%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.0425%/2.0250%。

周三美元兑人民币中间价报 7.0870，较上个交易日下调 160 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天震荡下行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.0893，较上一交易日下跌 50 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0914，较上一交易日下跌 195 个基点，目前两岸汇差在 21 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 100.81，较上一交易日下跌 0.21%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui