

# 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

【2024-08-19】

今日央行开展 521 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 745 亿，全口径资金净回笼 224 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.6820%，下行 1.80 个基点；7 天品种报 1.7220%，下行 8.90 个基点；1 个月品种报 1.8100%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8370%，下行 0.10 个基点。今日资金面整体均衡稍紧，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 1.2977%、1.7833%、1.9197%，全场倍数分别为 3.63 倍、4.68 倍、5.47 倍，边际倍数分别为 2.47 倍、1.00 倍、1.27 倍。国债期货早盘震荡走升，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.290，较上个交易日上涨 0.52%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.800，较上个交易日上涨 0.14%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.395，较上个交易日上涨 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.074，较上个交易日上涨 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率维持震荡，长端小幅下行，截至目前，剩余期限 9.71 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2295%/2.2260%，剩余期限 9.76 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1710%/2.1690%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1415，较上个交易日下调 49 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡下行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1383，较上一交易日下跌 297 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1355，较上一交易日下跌 275 个基点，目前两岸汇差倒挂在 20 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 102.09，较上一交易日下跌 0.30%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，8 月 16 日当周三人民币汇率指数全线下行，CFETS 人民币汇率指数报 98.39，环比下行 0.14；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 104.19，环比下行 0.22；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.10，环比下行 0.16。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui