



【2024-07-16】

今日央行开展 6760 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金净投放 6740 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.8940%，上行 11.40 个基点；7 天品种报 1.8940%，上行 7.30 个基点；1 个月品种报 1.8780%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8970%，上行 0.00 个基点。今日资金面早盘紧张，日内边际改善，尾盘转为均衡偏松，短期限资金价格明显上行。

上午发行的 5 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.9133%、2.2558%，全场倍数分别为 3.84 倍、3.20 倍，边际倍数分别为 3.38 倍、1.43 倍；下午发行的 2 年期、7 年期农发清发债中标收益率分别为 1.7210%、2.1073%，全场倍数分别为 3.55 倍、6.34 倍，边际倍数分别为 1.19 倍、4.50 倍。国债期货早盘震荡偏强，临近午盘大幅跳水后逐步收复失地，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 109.070，较上个交易日上涨 0.02%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.380，较上个交易日上涨 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.050，较上个交易日上涨 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 102.000，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，长端收益率冲高后逐步回落，截至目前，剩余期限 9.48 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3310%/2.3290%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2640%/2.2625%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1328，较上个交易日上调 15 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 7.2662，较上一交易日上涨 35 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2824，较上一交易日上涨 83 个基点，目前两岸汇差在 160 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 104.27，较上一交易日上涨 0.01%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui