

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

【2024-10-10】

今日央行开展 1500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2920 亿，全口径资金净回笼 1420 亿。Shibor 利率短端下行，长端上行，其中隔夜品种报 1.5270%，下行 9.10 个基点；7 天品种报 1.7000%，下行 10.30 个基点；1 个月品种报 1.8200%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.8410%，上行 0.00 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格下行。

上午发行的 3 年期、7 年期国开清发债中标收益率分别为 1.7503%、2.0733%，全场倍数分别为 3.41 倍、3.46 倍，边际倍数分别为 1.25 倍、2.50 倍；发行的 3 年期进出债中标收益率为 1.7716%，全场倍数为 4.41 倍，边际倍数为 1.58 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.9048%、2.1541%，全场倍数分别为 4.94 倍、3.74 倍，边际倍数分别为 1.70 倍、9.14 倍。国债期货全天震荡，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 112.430，较上个交易日上涨 0.96%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.860，较上个交易日上涨 0.31%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.690，较上个交易日上涨 0.26%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.280，较上个交易日上涨 0.07%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡下行，长端下行幅度较大，截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2225%/2.2175%，剩余期限 9.62 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1350%/2.1300%。

周四美元兑人民币中间价报 7.0742，较上个交易日上调 174 点。今日美元兑在岸、离岸人民币先抑后扬，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.0787，较上一交易日上涨 114 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0918，较上一交易日上涨 12 个基点，目前两岸汇差在 120 个基点附近。美元指数维持震荡，现报 102.92，较上一交易日上涨 0.02%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui