

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

【2024-08-02】

今日央行开展 11.7 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3580.5 亿，全口径资金净回笼 3568.8 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.5730%，下行 3.50 个基点；7 天品种报 1.7000%，上行 0.00 个基点；1 个月品种报 1.8250%，下行 0.30 个基点；3 个月品种报 1.8530%，下行 0.40 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 91 天期、30 年期国债中标收益率分别为 1.2392%、2.3406%，边际倍数分别为 1.2957%、--%，全场倍数分别为 2.67 倍、4.85 倍，边际倍数分别为 1.34 倍、15.46 倍；下午发行的 5 年期国开债中标收益率为 1.8034%，全场倍数为 2.55 倍，边际倍数为 2.01 倍。国债期货震荡偏强，主力合约多数收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 111.900，较上个交易日上涨 0.27%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 106.310，较上个交易日上涨 0.00%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.665，较上个交易日下跌 0.00%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 102.258，较上个交易日上涨 0.00%。债券市场交投活跃，现券收益率维持震荡，截至目前，剩余期限 9.76 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1950%/2.1940%，剩余期限 9.81 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1225%/2.1175%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1376，较上个交易日上调 53 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 7.2150，较上一交易日下跌 296 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2158，较上一交易日上涨 359 个基点，目前两岸汇差在 5 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 104.19，较上一交易日下跌 0.14%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui