



【2024-07-18】

今日央行开展 490 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，此外有 700 亿国库现金定存操作，全口径资金净投放 1170 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.9330%，上行 2.00 个基点；7 天品种报 1.8930%，上行 0.80 个基点；1 个月品种报 1.8790%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8970%，上行 0.10 个基点。今日资金面总体维持均衡稍紧态势，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的 3 年期、7 年期国开清发债中标收益率分别为 1.8498%、2.0905%，全场倍数分别为 1.75 倍、4.16 倍，边际倍数分别为 2.61 倍、3.50 倍；发行的 1 年期、3 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.4700%、1.8079%、2.3032%，全场倍数分别为 3.81 倍、4.52 倍、5.11 倍，边际倍数分别为 7.78 倍、7.08 倍、27.05 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.9519%、2.2600%，全场倍数分别为 5.46 倍、3.62 倍，边际倍数分别为 3.52 倍、15.08 倍。国债期货早盘震荡偏弱，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 108.820，较上个交易日下跌 0.20%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.300，较上个交易日下跌 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.025，较上个交易日下跌 0.04%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.996，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.48 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3370%/2.3360%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2700%/2.2650%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1285，较上个交易日下调 33 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏弱，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2572，较上一交易日下跌 79 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2707，较上一交易日下跌 14 个基点，目前两岸汇差在 130 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 103.83，较上一交易日上涨 0.10%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui