



【2024-09-03】

今日央行开展 12 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4725 亿，全口径资金净回笼 4713 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.5680%，上行 5.20 个基点；7 天品种报 1.6800%，下行 0.90 个基点；1 个月品种报 1.8220%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8500%，上行 0.00 个基点。今日资金面维持均衡附近波动，短期限资金价格上行。

上午发行的 2 年期、5 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.6600%、1.8351%、2.1836%，全场倍数分别为 3.72 倍、3.48 倍、3.32 倍，边际倍数分别为 1.80 倍、1.24 倍、1.33 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 1.7077%、2.0325%，全场倍数分别为 2.68 倍、4.06 倍，边际倍数分别为 1.03 倍、14.17 倍。国债期货窄幅震荡，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.900，较上个交易日上涨 0.06%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.065，较上个交易日上涨 0.03%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.805，较上个交易日上涨 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.298，较上个交易日上涨 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率长端小幅下行，截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2210%/2.2201%，剩余期限 9.72 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1375%/2.1360%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1112，较上个交易日上调 85 点。今日美元兑在岸、离岸人民币早盘震荡上行，午后涨幅收窄，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1171，较上一交易日上涨 56 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1195，较上一交易日上涨 30 个基点，目前两岸汇差在 30 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 101.71，较上一交易日上涨 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui