

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

【2024-07-26】

今日央行开展 3580.5 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 590 亿，全口径资金净投放 2990.5 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.6890%，下行 7.50 个基点；7 天品种报 1.9130%，上行 4.20 个基点；1 个月品种报 1.8480%，下行 0.70 个基点；3 个月品种报 1.8770%，下行 0.50 个基点。今日资金面整体均衡偏松，隔夜期限资金价格下行。

上午发行的 91 天期、182 天期国债中标收益率分别为 1.2392%、1.3345%，边际收益率分别为 1.3119%、1.4443%，全场倍数分别为 3.02 倍、2.25 倍，边际倍数分别为 5.05 倍、1.16 倍；下午发行的 5 年期国开债中标收益率为 1.8299%，全场倍数为 2.95 倍，边际倍数为 1.65 倍。国债期货震荡偏强，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 110.420，较上个交易日上涨 0.32%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.925，较上个交易日上涨 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.425，较上个交易日上涨 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 102.162，较上个交易日上涨 0.03%。债券市场交投活跃，长端现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.78 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2575%/2.2560%，剩余期限 9.83 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1870%/2.1850%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1270，较上个交易日下调 51 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡上行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2536，较上一交易日上涨 333 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2642，较上一交易日上涨 238 个基点，目前两岸汇差在 110 个基点附近。美元指数先下后上，现报 104.43，较上一交易日上涨 0.03%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui