



【2024-07-12】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金零投放零回笼。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.6680%，下行 0.20 个基点；7 天品种报 1.8010%，下行 0.20 个基点；1 个月品种报 1.8780%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8990%，下行 0.50 个基点。今日资金面整体均衡偏松，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的 91 天期、182 天期、5 年期国债中标收益率分别为 1.2997%、1.3629%、1.9400%，边际收益率分别为 1.3845%、1.4544%、--%，全场倍数分别为 2.98 倍、2.16 倍、4.07 倍，边际倍数分别为 2.66 倍、1.26 倍、4.15 倍；下午发行的 5 年期国开债中标收益率为 1.9200%，全场倍数为 4.82 倍，边际倍数为 2.18 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 108.880，较上个交易日上涨 0.35%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.245，较上个交易日上涨 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.965，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.974，较上个交易日上涨 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率小幅下行，截至目前，剩余期限 9.49 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3450%/2.3430%，剩余期限 9.62 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2680%/2.2660%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1315，较上个交易日下调 24 点。今日美元兑在岸、离岸人民币维持震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2585，较上一交易日下跌 125 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2740，较上一交易日上涨 63 个基点，目前两岸汇差在 150 个基点附近。美元指数全天震荡，现报 104.42，较上一交易日下跌 0.03%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui