



【2024-09-02】

今日央行开展 35 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4710 亿，全口径资金净回笼 4675 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.5160%，下行 1.30 个基点；7 天品种报 1.6890%，上行 4.20 个基点；1 个月品种报 1.8210%，下行 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，短期限资金价格小幅下行。

下午发行的 91 天期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.2977%、1.7561%、1.8800%，全场倍数分别为 3.14 倍、4.02 倍、4.54 倍，边际倍数分别为 2.09 倍、2.79 倍、11.25 倍。国债期货高开高走，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.850，较上个交易日上涨 0.58%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.030，较上个交易日上涨 0.29%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.700，较上个交易日上涨 0.23%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.266，较上个交易日上涨 0.11%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.67 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2240%/2.2205%，剩余期限 9.73 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1475%/2.1400%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1027，较上个交易日下调 97 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 7.1115，较上一交易日上涨 234 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1113，较上一交易日上涨 209 个基点，目前两岸汇差在 10 个基点附近。美元指数震荡偏弱，现报 101.62，较上一交易日下跌 0.11%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，8 月 30 日当周三大人民币汇率指数全线上行，CFETS 人民币汇率指数报 97.95，环比上行 0.06；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 103.67，环比上行 0.13；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 92.86，环比上行 0.30。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui