



【2024-08-20】

今日央行开展 1491 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3857 亿，全口径资金净回笼 2366 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7120%，上行 3.00 个基点；7 天品种报 1.7610%，上行 3.90 个基点；1 个月品种报 1.8120%，上行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.8380%，上行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡，日内有所收敛，尾盘转为均衡偏松，短期限资金价格上行。

上午发行的 5 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.8802%、2.1742%，全场倍数分别为 2.79 倍、2.31 倍，边际倍数分别为 1.61 倍、2.69 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 1.7470%、2.0499%，全场倍数分别为 3.41 倍、5.19 倍，边际倍数分别为 24.67 倍、10.00 倍；发行的 3 年期国开绿债清发中标收益率为 1.6300%，全场倍数为 3.08 倍，边际倍数为 2.26 倍。国债期货早盘震荡偏强，主力合约多数收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.460，较上个交易日上涨 0.22%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.790，较上个交易日上涨 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.400，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.054，较上个交易日下跌 0.02%。债券市场交投活跃，现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.71 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2300%/2.2260%，剩余期限 9.76 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1700%/2.1650%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1325，较上个交易日下调 90 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 7.1419，较上一交易日上涨 36 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1383，较上一交易日上涨 48 个基点，目前两岸汇差倒挂在 30 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 101.80，较上一交易日下跌 0.05%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui