市场概述
每日市场动态

常规报告系列

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-09-13】

今日央行开展 2362 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1415 亿，全口径资金净投放 947 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.6560%，下行 12.10 个基点；7 天品种报 1.8060%，上行 1.20 个基点；1 个月品种报 1.8300%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.8500%，上行 0.00 个基点。今日资金面总体均衡，尾盘趋于均衡偏松，隔夜期限资金价格下行。

上午发行的 1 年期、2 年期进出债中标收益率分别为 1.4221%、1.5800%，全场倍数分别为 3.68 倍、4.81 倍，边际倍数分别为 2.16 倍、1.68 倍；发行的 91 天期、7 年期国债中标收益率分别为 1.2917%、1.8700%，边际收益率分别为 1.3603%、1.9000%，全场倍数分别为 2.70 倍、2.52 倍，边际倍数分别为 2.49 倍、1.97 倍。国债期货维持震荡偏强，主力合约全线上行。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 114.330，较上个交易日上涨 0.70%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.805，较上个交易日上涨 0.17%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 105.205，较上个交易日上涨 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.456，较上个交易日上涨 0.05%。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 9.64 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1550%/2.1530%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.0670%/2.0650%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1030，较上个交易日下调 184 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天震荡下行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.0943，较上一交易日下跌 293 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0958，较上一交易日下跌 33 个基点，目前两岸汇差在 30 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 100.95，较上一交易日下跌 0.29%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui