



【2024-08-12】

今日央行开展 745 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 6.7 亿，全口径资金净投放 738.3 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.9510%，上行 17.30 个基点；7 天品种报 1.8930%，上行 9.80 个基点；1 个月品种报 1.8060%，上行 0.30 个基点；3 个月品种报 1.8330%，下行 0.05 个基点。今日资金面早盘偏紧，午后改善，短期限资金价格上行。

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 1.3179%、1.8009%、1.9662%，全场倍数分别为 3.62 倍、4.25 倍、4.38 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、1.00 倍、1.33 倍。国债期货低开震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 110.140，较上个交易日下跌 1.11%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.310，较上个交易日下跌 0.59%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.105，较上个交易日下跌 0.34%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 102.048，较上个交易日下跌 0.14%。债券市场交投活跃，现券收益率整体上行，截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.3000%/2.2950%，剩余期限 9.78 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.2400%/2.2375%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1458，较上个交易日上调 9 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏强，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1808，较上一交易日上涨 62 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1821，较上一交易日上涨 74 个基点，目前两岸汇差在 20 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 103.21，较上一交易日上涨 0.06%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，8 月 9 日当周三大人民币汇率指数全线下行，CFETS 人民币汇率指数报 98.53，环比下行 0.42；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 104.41，环比下行 0.61；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.26，环比下行 0.44。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui