

市场概述 每日市场动态

常规报告系列



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

【2024-10-18】

今日央行开展 1084 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 942 亿，资金净投放 142 亿，此外有 900 亿国库现金定存到期。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.3990%，下行 2.60 个基点；7 天品种报 1.5680%，上行 1.90 个基点；1 个月品种报 1.8180%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8580%，上行 0.30 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格小幅下行。

上午发行的 1 年期、2 年期进出债中标收益率分别为 1.4127%、1.6078%，全场倍数分别为 2.20 倍、3.75 倍，边际倍数分别为 5.29 倍、1.54 倍；发行的 20 年期特别国债中标收益率为 2.2986%，全场倍数为 2.46 倍，边际倍数为 1.01 倍。国债期货震荡下行，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 112.440，较上个交易日下跌 0.33%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.160，较上个交易日下跌 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.860，较上个交易日下跌 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.404，较上个交易日下跌 0.03%。债券市场交投活跃，股债跷跷板效应明显，现券收益率震荡走升，截至目前，剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1950%/2.1900%，剩余期限 9.60 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1125%/2.1050%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1274，较上个交易日上调 54 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡下行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1035，较上一交易日下跌 198 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1164，较上一交易日下跌 212 个基点，目前两岸汇差在 120 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 103.65，较上一交易日下跌 0.12%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui