



【2024-09-20】

今日央行开展 5719 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2362 亿，全口径资金净投放 3357 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.9320%，上行 5.30 个基点；7 天品种报 1.9290%，下行 1.80 个基点；1 个月品种报 1.8340%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8520%，上行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡偏紧，日内边际改善，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 91 天期、182 天期、20 年期国债中标收益率分别为 1.3120%、1.3408%、2.1596%，边际收益率分别为 1.3886%、1.4748%、--%，全场倍数分别为 2.21 倍、1.99 倍、2.74 倍，边际倍数分别为 1.77 倍、1.88 倍、2.81 倍。国债期货震荡走升，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 115.440，较上个交易日上涨 0.61%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.965，较上个交易日上涨 0.16%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 105.255，较上个交易日上涨 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.428，较上个交易日上涨 0.06%。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 9.62 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1200%/2.1165%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.0375%/2.0355%。

周五美元兑人民币中间价报 7.0644，较上个交易日下调 339 点。今日美元兑在岸、离岸人民币先下后上，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.0552，较上一交易日下跌 108 基点；美元兑离岸人民币现报 7.0563，较上一交易日下跌 147 个基点，目前两岸汇差在 0 个基点附近。美元指数早盘下行，午后回升，现报 100.74，较上一交易日上涨 0.11%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui