

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

【2024-05-16】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金零投放零回笼。Shibor 利率全线下行，其中隔夜品种报 1.7240%，下行 0.30 个基点；7 天品种报 1.8010%，下行 0.70 个基点；1 个月品种报 1.9110%，下行 1.20 个基点；3 个月品种报 1.9690%，下行 0.60 个基点。今日资金面整体偏松，尾盘有所收敛，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 3 年期、20 年期国开清发债中标收益率分别为 2.0036%、2.6047%，全场倍数分别为 2.88 倍、6.59 倍，边际倍数分别为 4.21 倍、10.37 倍；发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.9961%、2.1350%、2.4161%，全场倍数分别为 4.09 倍、3.80 倍、2.67 倍，边际倍数分别为 1.21 倍、1.20 倍、2.36 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.0211%、2.3489%，全程倍数分别为 5.76 倍、2.49 倍，边际倍数分别为 2.80 倍、5.24 倍。国债期货全天弱势震荡，午后跌幅扩大，主力合约全线下跌。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 105.720，较上个交易日下跌 0.35%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.270，较上个交易日下跌 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.325，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.704，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘震荡，午后上行，截至目前，剩余期限 9.65 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4170%/2.4140%，剩余期限 9.78 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3150%/2.313%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1020，较上个交易日下调 29 点。今日美元兑在岸、离岸人民币低开高走，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2188，较上一交易日下跌 7 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2224，较上一交易日上涨 47 个基点，目前两岸汇差在 30 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 104.37，较上一交易日上涨 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui