

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

【2024-05-15】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购、1250 亿 1 年期 MLF 操作，操作利率维持不变，逆回购到期 20 亿，MLF 到期 1250 亿，全口径资金零投放零回笼。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.7270%，下行 4.20 个基点；7 天品种报 1.8080%，下行 2.90 个基点；1 个月品种报 1.9230%，下行 0.40 个基点；3 个月品种报 1.9750%，下行 0.20 个基点。今日资金面整体偏松，短期限资金价格小幅下行。

上午发行的 7 年期进出清发债中标收益率为 2.2600%，全场倍数为 4.60 倍，边际倍数为 1.08 倍；下午发行的 1 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.6301%、2.4096%，全场倍数分别为 2.33 倍、2.49 倍，边际倍数分别为 1.29 倍、1.54 倍。国债期货早盘震荡偏强，午后涨幅回落，主力合约多数下跌。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 106.430，较上个交易日下跌 0.09%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.440，较上个交易日下跌 0.00%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.390，较上个交易日下跌 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.726，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘震荡，午后有所上行，截至目前，剩余期限 9.65 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4000%/2.3980%，剩余期限 9.78 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2990%/2.2975%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1049，较上个交易日下调 4 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 7.2195，较上一交易日下跌 182 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2206，较上一交易日下跌 195 个基点，目前两岸汇差倒挂在 10 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 104.83，较上一交易日下跌 0.16%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui