

# 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

【2024-05-22】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，此外有 700 亿国库现金定存操作，全口径资金净投放 700 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7790%，上行 2.10 个基点；7 天品种报 1.8380%，下行 0.90 个基点；1 个月品种报 1.9080%，上行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.9580%，上行 0.00 个基点。今日资金面早盘均衡偏松，日内边际宽松，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的 7 年期进出清发债中标收益率为 2.3059%，全场倍数为 4.21 倍，边际倍数为 4.00 倍；发行的 1 年期、5 年期国债中标收益率分别为 1.5244%、2.0330%，边际收益率分别为 1.5793%、2.0655%，全场倍数分别为 2.55 倍、3.83 倍，边际倍数分别为 1.02 倍、1.55 倍；下午发行的 1 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.6204%、2.4344%，全场倍数分别为 2.45 倍、2.24 倍，边际倍数分别为 1.04 倍、1.67 倍。国债期货全天震荡偏强，主力合约全线上涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 105.970，较上个交易日上涨 0.29%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.275，较上个交易日上涨 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.375，较上个交易日上涨 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.746，较上个交易日上涨 0.05%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，中短端小幅下行，长端窄幅波动，截至目前，剩余期限 9.63 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4150%/2.4135%，剩余期限 9.76 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3140%/2.3100%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1077，较上个交易日上调 8 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 7.2396，较上一交易日上涨 26 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2487，较上一交易日上涨 19 个基点，目前两岸汇差在 90 个基点附近。美元指数维持震荡，现报 104.70，较上一交易日上涨 0.04%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui