



【2024-05-20】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 40 亿，全口径资金净回笼 20 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.7190%，上行 0.00 个基点；7 天品种报 1.8030%，下行 0.50 个基点；1 个月品种报 1.9050%，下行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.9580%，下行 0.50 个基点。今日资金面早盘均衡偏松，日内边际收敛，尾盘均衡偏紧，短期限资金价格小幅上行。

下午发行的 91 天期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.4088%、1.9959%、2.1510%，全场倍数分别为 2.87 倍、3.35 倍、2.97 倍，边际倍数分别为 3.50 倍、2.36 倍、2.27 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 105.740，较上个交易日上涨 0.36%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.280，较上个交易日上涨 0.22%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.390，较上个交易日上涨 0.13%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.732，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率全天窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.64 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4100%/2.4090%，剩余期限 9.77 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3100%/2.3075%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1042，较上个交易日下调 3 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 7.2320，较上一交易日上涨 78 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2398，较上一交易日上涨 61 个基点，目前两岸汇差在 80 个基点附近。美元指数先下后升，现报 104.47，较上一交易日下跌 0.03%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，5 月 17 日当周三大人民币汇率指数全线下跌，CFETS 人民币汇率指数报 99.43，环比下跌 0.67；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.06，环比下跌 0.63；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.28，环比下跌 0.37。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui