

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

【2024-05-31】

今日央行开展 1000 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金净投放 980 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.8050%，上行 5.90 个基点；7 天品种报 1.8510%，下行 5.20 个基点；1 个月品种报 1.9070%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.9550%，下行 0.20 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 1 年期、2 年期进出债中标收益率分别为 1.5730%、1.8201%，全场倍数分别为 3.47 倍、5.70 倍，边际倍数分别为 1.90 倍、1.02 倍。国债期货全天弱势震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 106.460，较上个交易日下跌 0.66%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.350，较上个交易日下跌 0.16%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.445，较上个交易日下跌 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.758，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，早盘高开低走，午后长端冲高回落，截至目前，剩余期限 9.61 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4100%/2.4050%，剩余期限 9.74 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3175%/2.3160%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1088，较上个交易日下调 23 点。今日美元兑在岸、离岸人民币窄幅震荡上行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2440，较上一交易日下跌 15 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2634，较上一交易日上涨 104 个基点，目前两岸汇差在 190 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 104.80，较上一交易日上涨 0.05%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui