



【2024-10-23】

今日央行开展 7927 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 6424 亿，资金净投放 1503 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.4900%，上行 1.30 个基点；7 天品种报 1.5950%，上行 1.60 个基点；1 个月品种报 1.8200%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.8730%，上行 0.40 个基点。今日资金面整体均衡，隔夜期限资金价格小幅波动。

上午发行的 91 天期、182 天期国债中标收益率分别为 1.3644%、1.3954%，边际收益率分别为 1.4573%、1.5053%，全场倍数分别为 1.96 倍、2.09 倍，边际倍数分别为 3.93 倍、29.00 倍；下午发行的 1.0548 年期、3 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.5442%、2.0405%、2.2300%，全场倍数分别为 2.41 倍、3.16 倍、2.34 倍，边际倍数分别为 1.05 倍、1.00 倍、2.15 倍。国债期货弱势震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.530，较上个交易日下跌 0.45%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.870，较上个交易日下跌 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.580，较上个交易日下跌 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.276，较上个交易日下跌 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘上行，午后回落，整体小幅上行，截至目前，剩余期限 9.53 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2275%/2.2250%，剩余期限 9.59 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1450%/2.1400%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1245，较上个交易日上调 22 点。今日美元兑在岸、离岸人民币维持震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1268，较上一交易日上涨 56 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1397，较上一交易日上涨 38 个基点，目前两岸汇差在 120 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 104.30，较上一交易日上涨 0.22%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui