



【2024-05-21】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金零投放零回笼。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7580%，上行 3.90 个基点；7 天品种报 1.8470%，上行 4.40 个基点；1 个月品种报 1.9060%，上行 0.10 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，日内边际收敛，尾盘有所改善，短期限资金价格小幅上行。

上午发行的 5 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.0683%、2.3434%，全场倍数分别为 2.84 倍、2.87 倍，边际倍数分别为 1.06 倍、3.26 倍；下午发行的 2 年期、3 年期、7 年期农发清发债中标收益率分别为 1.8922%、2.0226%、2.2615%，全场倍数分别为 2.76 倍、4.41 倍、4.76 倍，边际倍数分别为 1.79 倍、1.17 倍、1.00 倍。国债期货全天弱势震荡，主力合约全线下跌。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 105.670，较上个交易日下跌 0.12%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.210，较上个交易日下跌 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.320，较上个交易日下跌 0.08%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.692，较上个交易日下跌 0.05%。债券市场交投活跃，现券收益率先上后下，小幅上行，截至目前，剩余期限 9.64 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4090%/2.4075%，剩余期限 9.77 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3100%/2.3080%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1069，较上个交易日上调 27 点。今日美元兑在岸、离岸人民币窄幅震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2370，较上一交易日上涨 50 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2442，较上一交易日下跌 29 个基点，目前两岸汇差在 60 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 104.59，较上一交易日下跌 0.03%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui