



【2024-10-22】

今日央行开展 1584 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 683 亿，资金净投放 901 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.4770%，上行 0.30 个基点；7 天品种报 1.5790%，下行 0.50 个基点；1 个月品种报 1.8200%，上行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.8690%，上行 0.50 个基点。今日资金面整体均衡稍松，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的 2 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.5949%、2.1166%，全场倍数分别为 2.61 倍、3.16 倍，边际倍数分别为 2.75 倍、6.85 倍；下午发行的 2 年期、7 年期农发清发债中标收益率分别为 1.6788%、2.0607%，全场倍数分别为 4.18 倍、3.43 倍，边际倍数分别为 1.50 倍、1.14 倍。国债期货震荡下行，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 111.920，较上个交易日下跌 0.52%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.035，较上个交易日下跌 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.690，较上个交易日下跌 0.14%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.318，较上个交易日下跌 0.07%。债券市场交投活跃，现券收益率午后震荡上行，截至目前，剩余期限 9.54 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2200%/2.2110%，剩余期限 9.59 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1350%/2.1325%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1223，较上个交易日上调 241 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 7.1212，较上一交易日上涨 94 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1332，较上一交易日下跌 28 个基点，目前两岸汇差在 130 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 103.86，较上一交易日下跌 0.12%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui