



【2024-06-17】

今日央行开展 40 亿 7 天期逆回购、1820 亿 1 年期 MLF 操作，操作利率维持不变，无逆回购到期，MLF 到期 2370 亿，全口径资金净回笼 510 亿。Shibor 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 1.7830%，上行 5.10 个基点；7 天品种报 1.8620%，上行 4.90 个基点；1 个月品种报 1.8980%，下行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.9350%，下行 0.40 个基点。今日资金面整体均衡偏紧，短期限资金价格小幅上行。

下午发行的 3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.9255%、2.0661%，全场倍数分别为 4.24 倍、5.61 倍，边际倍数分别为 2.05 倍、12.69 倍。国债期货全天震荡，主力合约涨跌互现。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 108.040，较上个交易日上涨 0.13%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.765，较上个交易日上涨 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.580，较上个交易日下跌 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.774，较上个交易日下跌 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率维持震荡，长端小幅下行，短端小幅上行，截至目前，剩余期限 9.56 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3740%/2.3720%，剩余期限 9.69 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2910%/2.2900%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1149，较上个交易日下调 2 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 7.2559，较上一交易日上涨 2 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2703，较上一交易日下跌 8 个基点，目前两岸汇差在 140 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 105.54，较上一交易日上涨 0.02%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，6 月 14 日当周三大人民币汇率指数全线上行，CFETS 人民币汇率指数报 99.89，环比上涨 0.40；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.84，环比上涨 0.60；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.45，环比上涨 0.43。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui