



【2024-06-24】

今日央行开展 500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 40 亿，全口径资金净投放 460 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.9800%，上行 2.00 个基点；7 天品种报 2.0080%，上行 6.90 个基点；1 个月品种报 1.9000%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.9220%，下行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡偏紧，日内边际改善，尾盘均衡偏松，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 1 年期、7 年期国债中标收益率分别为 1.4982%、2.1200%，边际收益率分别为 1.5442%、2.1400%，全场倍数分别为 2.60 倍、3.28 倍，边际倍数分别为 1.47 倍、1.91 倍；下午发行的 3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.8826%，2.0088%，全场倍数分别为 5.15 倍、5.80 倍，边际倍数分别为 58.00 倍、1.10 倍。国债期货震荡走升，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 108.730，较上个交易日上涨 0.39%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.055，较上个交易日上涨 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.820，较上个交易日上涨 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.890，较上个交易日上涨 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.54 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3460%/2.3450%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2675%/2.2650%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1201，较上个交易日上调 5 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 7.2618，较上一交易日上涨 5 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2885，较上一交易日下跌 20 个基点，目前两岸汇差在 270 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 105.65，较上一交易日下跌 0.17%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，6 月 21 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 99.97，环比上涨 0.08；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 106.08，环比上涨 0.24；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.62，环比上涨 0.17。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui