



【2024-06-06】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2600 亿，全口径资金净回笼 2580 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.6560%，下行 0.80 个基点；7 天品种报 1.7800%，上行 0.40 个基点；1 个月品种报 1.8970%，下行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.9480%，上行 0.00 个基点。今日资金面整体均衡，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 3 年期、7 年期国开清发债中标收益率分别为 1.9142%、2.1665%，全场倍数分别为 2.77 倍、4.33 倍，边际倍数分别为 1.46 倍、1.14 倍；发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.9174%、2.0517%、2.3825%，全场倍数分别为 5.15 倍、6.79 倍、5.49 倍，边际倍数分别为 1.27 倍、5.00 倍、7.21 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.0111%、2.3185%，全场倍数分别为 6.07 倍、4.56 倍，边际倍数分别为 1.43 倍、8.04 倍。国债期货全天窄幅震荡，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 107.060，较上个交易日上涨 0.07%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.675，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.655，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.830，较上个交易日上涨 0.00%。债券市场交投活跃，现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.59 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3900%/2.3860%，剩余期限 9.72 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3060%/2.3040%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1108，较上个交易日上调 11 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏强，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2473，较上一交易日上涨 8 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2640，较上一交易日上涨 50 个基点，目前两岸汇差在 170 个基点附近。美元指数震荡回升，现报 104.32，较上一交易日上涨 0.00%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui