市场概述
每日市场动态

常规报告系列

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-06-12】

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 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.6800%，上行 0.10 个基点；7 天品种报 1.7960%，下行 0.60 个基点；1 个月品种报 1.8980%，下行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.9430%，下行 0.40 个基点。今日资金面整体均衡，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的进出清发债中标收益率为 1.5500%，全场倍数为 4.16 倍，边际倍数为 1.24 倍；发行的 91 天期、5 年期、10 年期国债中标收益率分别为 1.3568%、1.9943%、2.2392%，边际收益率分别为 1.4330%、2.0190%、2.2617%，全场倍数分别为 2.62 倍、3.32 倍、4.45 倍，边际倍数分别为 1.96 倍、1.50 倍、1.04 倍；下午发行的 1 年期、3 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.5969%、2.0004%、2.3848%，全场倍数分别为 2.58 倍、4.93 倍、3.32 倍，边际倍数分别为 36.67 倍、1.53 倍、1.81 倍。国债期货全天弱势震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 107.290，较上个交易日下跌 0.16%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.695，较上个交易日下跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.645，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.834，较上个交易日下跌 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率窄幅震荡，小幅上行，截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3885%/2.3875%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3045%/2.3030%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1133，较上个交易日下调 2 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏弱，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2537，较上一交易日下跌 4 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2700，较上一交易日下跌 17 个基点，目前两岸汇差在 170 个基点附近。美元指数震荡偏弱，现报 105.19，较上一交易日下跌 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui