



【2024-06-28】

今日央行开展 500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 100 亿，全口径资金净投放 400 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.8890%，上行 1.00 个基点；7 天品种报 2.0990%，上行 7.10 个基点；1 个月品种报 1.9000%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.9180%，上行 0.00 个基点。今日资金面日内偏紧，直至尾盘大幅缓解，短期限资金价格有所上行。

国债期货震荡偏强，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 109.490，较上个交易日上涨 0.08%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.320，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.005，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.978，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率小幅上行，截至目前，剩余期限 9.53 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3150%/2.3130%，剩余期限 9.66 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2320%/2.2310%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1268，较上个交易日下调 2 点。今日美元兑在岸、离岸人民币小幅下行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2659，较上一交易日下跌 30 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2992，较上一交易日下跌 38 个基点，目前两岸汇差在 330 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 106.03，较上一交易日上涨 0.10%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui