



【2024-07-01】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 500 亿，全口径资金净回笼 480 亿。Shibor 利率全线下行，其中隔夜品种报 1.7490%，下行 14.00 个基点；7 天品种报 1.8020%，下行 29.70 个基点；1 个月品种报 1.8990%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.9170%，下行 0.10 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格大幅下行。

下午发行的 91 天期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.4997%、1.8505%、1.9853%，全场倍数分别为 2.45 倍、4.62 倍、6.10 倍，边际倍数分别为 1.25 倍、2.00 倍、1.06 倍。国债期货早盘震荡偏强，午后受央行公告近期开展国债借入操作的影响，大幅跳水，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 108.440，较上个交易日下跌 1.06%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.975，较上个交易日下跌 0.37%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.765，较上个交易日下跌 0.24%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.884，较上个交易日下跌 0.08%。债券市场交投活跃，现券收益率大幅上行，截至目前，剩余期限 9.52 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3550%/2.35250%，剩余期限 9.65 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2700%/2.2650%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1265，较上个交易日下调 3 点。今日美元兑在岸、离岸人民币小幅震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2684，较上一交易日上涨 25 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2987，较上一交易日下跌 8 个基点，目前两岸汇差在 300 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 105.53，较上一交易日下跌 0.29%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，6 月 28 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 100.04，环比上涨 0.07；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 106.27，环比上涨 0.19；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.68，环比上涨 0.06。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui