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

【2024-06-18】

今日央行开展 860 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金净投放 840 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.8290%，上行 4.60 个基点；7 天品种报 1.8820%，上行 2.00 个基点；1 个月品种报 1.9000%，上行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.9340%，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上行。

上午发行的 5 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.9963%、2.2724%，全场倍数分别为 3.50 倍、4.20 倍，边际倍数分别为 1.23 倍、1.48 倍；下午发行的农发清发债中标收益率分别为 1.8119%、2.1800%，全场倍数分别为 4.33 倍、7.24 倍，边际倍数分别为 6.50 倍、1.75 倍。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 108.320，较上个交易日上涨 0.26%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.855，较上个交易日上涨 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.665，较上个交易日上涨 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.828，较上个交易日上涨 0.05%。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 9.56 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3615%/2.3610%，剩余期限 9.69 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2815%/2.2805%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1148，较上个交易日下调 1 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 7.2562，较上一交易日上涨 3 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2753，较上一交易日上涨 48 个基点，目前两岸汇差在 190 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 105.48，较上一交易日上涨 0.14%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui