

市场概述 晨报

常规报告系列



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

【2026-06-23】

财经新闻

(1) **央行发布 2026 年 5 月金融市场运行情况。**2026 年 5 月，同业拆借日均成交 4172.8 亿元，同比增加 18.5%；银行间市场债券回购日均成交 7.4 万亿元，同比增加 8.1%。2026 年 5 月末，同业拆借未到期余额 1.0 万亿元，银行间市场债券回购未到期余额 10.1 万亿元。5 月政府债券净融资 12235.5 亿元，同比减少 2349.8 亿元；企业债券净融资 1680.4 亿元，同比增加 183.9 亿元。前 5 个月，熊猫债券累计发行 1329.8 亿元，新增 17 家境外机构进入银行间债券市场。

(2) **财政部：前 5 月全国一般公共预算收入超 10 万亿元，证券交易印花税同比大增 88.8%。**1-5 月全国一般公共预算收入 100465 亿元，同比增长 4%，支出 113877 亿元，同比增长 0.8%。税收收入中，国内增值税、个人所得税等增长较快，证券交易印花税同比大增 88.8%；而契税、土地增值税等有所下降。

(3) **外汇交易中心离岸人民币外汇衍生品交易有序落地。**6 月 22 日，工商银行、中国银行、交通银行和中信银行依托中国外汇交易中心交易平台，落地多笔离岸人民币外汇期权、货币掉期等衍生品交易，交易对手覆盖多家境外金融机构。此次交易进一步展现了试点银行离岸人民币外汇衍生品定价及交易能力。目前已有 22 家机构提供流动性。外汇交易中心表示，下一步将持续丰富交易品种和机制，引入更多境内外市场参与主体，打造更透明高效、更具流动性的离岸人民币外汇交易平台，助力上海国际金融中心建设。

市场动态

(1) 周一央行开展 4765 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 8180 亿，逆回购口径资金净回笼 3415 亿。今日逆回购到期 4495.00 亿元。周一资金面整体偏紧。

(2) 周一国债期货主力合约全线上涨，现券收益率维持震荡。10 年期国债期货主力合约 T2609 收报 109.060，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2609 收报 106.320，较上个交易日上涨 0.01%。剩余期限 9.70 年的国开债活跃券 260205 收益率报 1.7820%/1.7815%，剩余期限 9.90 年的国债活跃券 260010 收益率报 1.7300%/1.7290%。

(3) 据中国外汇交易中心数据显示，上个交易日夜盘在岸人民币兑美元（CNY）收报 6.7773，较前一交易日夜盘收跌 45 个基点。

一级市场

今日银行间市场有 26 江苏债 29 等地方政府债共 3 只，计划发行规模 235.24 亿；26 工商银行 CD120 等同业存单共 112 只，计划发行规模 2082.50 亿；26 国开 01(增 15)等金融债共 9 只，计划发行规模 395.00 亿；26 国家核电 MTN002 等中期票据共 20 只，计划发行规模 141.94 亿；26 电网 CP004 等短期融资券共 22 只，计划发行规模 296.42 亿；26 江北工投 PPN001 等定向工具共 6 只，计划发行规模 35.33 亿；26 日银 1C 等资产支持证券共 41 只，计划发行规模 246.84 亿。共计 213 只债券发行，计划发行规模 3433.27 亿。

以上仅供参考，谢谢！

免责声明：本报告由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用报告内容。

报告所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，信息不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本报告任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。