

市场概述 每日市场动态

常规报告系列



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

【2024-06-13】

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 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 1.7230%，上行 4.30 个基点；7 天品种报 1.8170%，上行 2.10 个基点；1 个月品种报 1.9000%，上行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.9400%，下行 0.30 个基点。今日资金面整体均衡偏紧，尾盘改善，短期限资金价格小幅上行。

上午发行的 3 年期、7 年期国开清发债中标收益率分别为 1.9166%、2.1637%，全场倍数分别为 3.67 倍、4.33 倍，边际倍数分别为 4.77 倍、2.25 倍；发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.9089%、2.0494%、2.3602%，全场倍数分别为 5.15 倍、6.73 倍、6.11 倍，边际倍数分别为 23.14 倍、2.17 倍、2.11 倍；下午发行的 3 年期、3+2 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.9453%、2.1800%、2.2962%，全场倍数分别为 5.06 倍、3.22 倍、4.25 倍，边际倍数分别为 1.90 倍、1.15 倍、13.87 倍。国债期货全天震荡，主力合约涨跌互现。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 107.620，较上个交易日上涨 0.28%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.720，较上个交易日上涨 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.615，较上个交易日下跌 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.816，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率窄幅震荡，短端小幅上行，长端小幅下行，截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3825%/2.3820%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3000%/2.2995%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1122，较上个交易日下调 11 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 7.2520，较上一交易日下跌 17 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2667，较上一交易日上涨 34 个基点，目前两岸汇差在 150 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 104.75，较上一交易日上涨 0.04%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui