



【2024-06-11】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 40 亿，全口径资金净回笼 20 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.6790%，下行 4.00 个基点；7 天品种报 1.8020%，上行 5.10 个基点；1 个月品种报 1.9000%，上行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.9470%，下行 0.20 个基点。今日资金面整体均衡，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 5 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.0056%、2.3130%，全场倍数分别为 3.43 倍、3.78 倍，边际倍数分别为 5.89 倍、4.00 倍；下午发行的 2 年期、7 年期农发清发债中标收益率分别为 1.8232%、2.2030%，全场倍数分别为 4.36 倍、6.56 倍，边际倍数分别为 1.65 倍、14.38 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 107.440，较上个交易日上涨 0.27%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.760，较上个交易日上涨 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.705，较上个交易日上涨 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.862，较上个交易日上涨 0.02%。债券市场交投活跃，现券收益率窄幅震荡，小幅下行，截至目前，剩余期限 9.58 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3840%/2.3825%，剩余期限 9.71 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3040%/2.3030%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1135，较上个交易日上调 29 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏强，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2541，较上一交易日上涨 115 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2702，较上一交易日上涨 44 个基点，目前两岸汇差在 160 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 105.21，较上一交易日上涨 0.08%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，6 月 7 日当周三大人民币汇率指数全线下行，CFETS 人民币汇率指数报 99.49，环比下跌 0.30；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.24，环比下跌 0.29；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.02，环比下跌 0.29。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui