



【2024-06-05】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2500 亿，全口径资金净回笼 2480 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.6640%，上行 0.10 个基点；7 天品种报 1.7760%，下行 0.90 个基点；1 个月品种报 1.8990%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.9480%，下行 0.10 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 7 年期进出清发债中标收益率为 2.2347%，全场倍数为 6.15 倍，边际倍数为 1.39 倍；发行的 28 天期、63 天期、3 年国债中标收益率分别为 1.0829%、1.2134%、1.8749%，边际收益率分别为 1.1873%、1.3240%、1.9396%，全场倍数分别为 3.23 倍、3.01 倍、3.45 倍，边际倍数分别为 1.69 倍、19.33 倍、4.08 倍；下午发行的 1 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.5999%、2.3962%，全场倍数分别为 2.65 倍、2.80 倍，边际倍数分别为 2.69 倍、3.06 倍。国债期货全天震荡偏强，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 107.010，较上个交易日上涨 0.19%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.670，较上个交易日上涨 0.13%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.645，较上个交易日上涨 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.832，较上个交易日上涨 0.04%。债券市场交投活跃，现券收益率小幅下行，截至目前，剩余期限 9.59 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3900%/2.3870%，剩余期限 9.72 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3050%/2.3040%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1097，较上个交易日上调 14 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 7.2465，较上一交易日上涨 21 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2554，较上一交易日上涨 76 个基点，目前两岸汇差在 90 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 104.31，较上一交易日上涨 0.15%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui