



【2024-06-20】

今日央行开展 200 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金净投放 180 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.8770%，上行 2.40 个基点；7 天品种报 1.8900%，上行 2.90 个基点；1 个月品种报 1.9000%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 1.9270%，下行 0.20 个基点。今日资金面整体均衡偏紧，隔夜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 1.8748%、2.1414%，全场倍数分别为 3.18 倍、4.58 倍，边际倍数分别为 1.63 倍、1.75 倍；发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出债中标收益率分别为 1.8781%、2.0027%、2.3195%，全场倍数分别为 5.94 倍、7.13 倍、5.01 倍，边际倍数分别为 4.06 倍、1.20 倍、2.17 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 1.9463%、2.2648%，全场倍数分别为 4.92 倍、3.77 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、3.18 倍。国债期货维持震荡，主力合约多数收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 108.770，较上个交易日上涨 0.39%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.015，较上个交易日上涨 0.07%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.770，较上个交易日上涨 0.00%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.868，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率涨跌互现，截至目前，剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3490%/2.3480%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2700%/2.2670%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1192，较上个交易日上调 33 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 7.2605，较上一交易日上涨 35 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2865，较上一交易日上涨 53 个基点，目前两岸汇差在 260 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 105.49，较上一交易日上涨 0.24%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui