

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

【2024-04-22】

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 利率全线下行，其中隔夜品种报 1.7800%，下行 1.70 个基点；7 天品种报 1.8310%，下行 3.90 个基点；1 个月品种报 1.9720%，下行 1.70 个基点；3 个月品种报 2.0270%，下行 0.80 个基点。今日资金面维持均衡附近波动，隔夜期限资金价格小幅下行。

下午发行的 91 天期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.5805%、1.9903%、2.1009%，全场倍数分别为 1.78 倍、4.81 倍、4.45 倍，边际倍数分别为 4.58 倍、11.25 倍、2.53 倍。国债期货全天震荡偏强，主力合约多数上行。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 107.820，较上个交易日上涨 0.36%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.645，较上个交易日上涨 0.06%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.495，较上个交易日上涨 0.01%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.704，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.71 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3120%/2.3110%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2460%/2.2440%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1043，较上个交易日下调 3 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 7.2436，较上一交易日上涨 35 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2522，较上一交易日上涨 13 个基点，目前两岸汇差在 90 个基点附近。美元指数震荡上行，现报 106.12，较上一交易日上涨 0.01%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，4 月 19 日当周三人民币汇率指数全线上涨，CFETS 人民币汇率指数报 100.73，环比涨 0.68；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 106.22，环比涨 0.76；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.99，环比涨 0.34。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui