

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

【2024-04-01】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 500 亿，全口径资金净回笼 480 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.7280%，上行 1.00 个基点；7 天品种报 1.8570%，下行 11.00 个基点；1 个月品种报 2.1280%，下行 1.20 个基点；3 个月品种报 2.1570%，上行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡偏紧，午后转为均衡偏松，隔夜期限资金价格小幅波动。

下午发行的 1 年期、3 年期、5 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.6706%、2.0997%、2.2556%、2.4700%，全场倍数分别为 2.54 倍、2.81 倍、3.67 倍、3.13 倍，边际倍数分别为 1.02 倍、5.96 倍、4.89 倍、2.86 倍。国债期货全天弱势震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 105.800，较上个交易日下跌 0.53%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 103.785，较上个交易日下跌 0.26%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 102.980，较上个交易日下跌 0.17%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.582，较上个交易日下跌 0.06%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘上行后维持震荡，截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4325%/2.4300%，剩余期限 9.90 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3125%/2.3100%。

周一美元兑人民币中间价报 7.0938，较上个交易日下调 12 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天窄幅震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2293，较上一交易日上涨 61 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2491，较上一交易日下跌 84 个基点，目前两岸汇差在 190 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 104.54，较上一交易日上涨 0.04%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，3 月 29 日当周三大人民币汇率指数全线上涨，CFETS 人民币汇率指数报 99.78，环比上涨 0.48；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.09，环比上涨 0.51；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.43，环比上涨 0.34。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui