

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

【2024-03-14】

今日央行开展 30 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 100 亿，全口径资金净回笼 70 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7460%，上行 1.10 个基点；7 天品种报 1.8800%，下行 0.20 个基点；1 个月品种报 2.1000%，上行 0.50 个基点；3 个月品种报 2.1610%，上行 0.20 个基点。今日资金面总体均衡，尾盘趋于偏松，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的 20 年期国开清发债中标收益率为 2.6292%，全场倍数为 2.07 倍，边际倍数为 1.41 倍；发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出口行债中标收益率分别为 2.1758%、2.3100%、2.5048%，全场倍数分别为 4.60 倍、5.27 倍、3.65 倍，边际倍数分别为 11.67 倍、7.50 倍、3.30 倍；发行的 2 年期、10 年期国债中标收益率分别为 1.9900%、2.3126%，边际收益率分别为 1.9900%、3.3299%，全场倍数分别为 3.30 倍、3.80 倍，边际倍数分别为 1.43 倍、1.01 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.2800%、2.4100%，全场倍数分别为 4.38 倍、2.40 倍，边际倍数分别为 10.00 倍、1.48 倍。国债期货全天维持震荡，主力合约多数收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 105.610，较上个交易日上涨 0.09%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 103.715，较上个交易日下跌 0.10%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 102.805，较上个交易日下跌 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.394，较上个交易日下跌 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡走升，截至目前，剩余期限 9.19 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.4825%/2.4800%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 230026 收益率报 2.3475%/2.3470%。

周四美元兑人民币中间价报 7.0974，较上个交易日上调 44 点。今日美元兑在岸、离岸人民币维持震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1911，较上一交易日下跌 34 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.1958，较上一交易日上涨 22 个基点，目前两岸汇差在 40 个基点附近。美元指数全天震荡上行，现报 102.88，较上一交易日上涨 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui