市场概述

每日市场动态

常规报告系列

上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-02-01】

今日央行开展 430 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4660 亿，全口径资金净回笼 4230 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.6760%，下行 3.20 个基点；7 天品种报 1.8090%，下行 2.00 个基点；1 个月品种报 2.2620%，下行 2.00 个基点；3 个月品种报 2.3750%，下行 1.30 个基点。今日资金面总体维持均衡附近波动，日内稍有收敛，短期限资金价格小幅下行。

下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.3988%、2.5514%，全场倍数分别为 4.22 倍、2.90 倍，边际倍数分别为 1.00 倍、8.69 倍。国债期货弱势震荡，主力合约全线下跌。30 年期国债期货主力合约 TL2403 收报 105.140，较上个交易日下跌 0.20%；10 年期国债期货主力合约 T2403 收报 103.495，较上个交易日下跌 0.05%；5 年期国债期货主力合约 TF2403 收报 102.845，较上个交易日下跌 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2403 收报 101.348，较上个交易日下跌 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率窄幅震荡，截至目前，剩余期限 9.30 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.6325%/2.6300%，剩余期限 9.81 年的国债活跃券 230026 收益率报 2.4350%/2.4345%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1049，较上个交易日上调 10 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡走升，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1832，较上一交易日上涨 37 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.1959，较上一交易日上涨 95 个基点，目前两岸汇差在 120 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 103.75，较上一交易日上涨 0.22%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui