

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

【2024-04-23】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，国库现金定存到期 700 亿，全口径资金净回笼 700 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.7880%，上行 0.80 个基点；7 天品种报 1.8240%，下行 0.70 个基点；1 个月品种报 1.9630%，下行 0.90 个基点；3 个月品种报 2.0180%，下行 0.90 个基点。今日资金面早盘均衡，尾盘均衡偏松，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的 3+2 年期、5 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.1538%、2.0076%、2.2459%，全场倍数分别为 4.62 倍、4.06 倍、3.08 倍，边际倍数分别为 1.67 倍、18.45 倍、1.72 倍；发行的 2 年期进出绿色债中标收益率为 1.7300%，全场倍数为 7.55 倍，边际倍数为 6.00 倍，下午发行的 2 年期、7 年期农发清发债中标收益率分别为 1.8720%、2.2061%，全场倍数分别为 4.49 倍、8.20 倍，边际倍数分别为 1.72 倍、1.49 倍。国债期货全天震荡上行，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 108.350，较上个交易日上涨 0.49%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.845，较上个交易日上涨 0.17%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.610，较上个交易日上涨 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.746，较上个交易日上涨 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，长端下行幅度较大，截至目前，剩余期限 9.71 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.2900%/2.2885%，剩余期限 9.84 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2200%/2.2160%。

周二美元兑人民币中间价报 7.1059，较上个交易日上调 16 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 7.2466，较上一交易日上涨 30 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2585，较上一交易日上涨 72 个基点，目前两岸汇差在 120 个基点附近。美元指数早盘震荡上行，午后跳水走低，现报 105.96，较上一交易日下跌 0.16%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui