

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

【2024-04-18】

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 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 1.7760%，上行 5.30 个基点；7 天品种报 1.8360%，上行 2.00 个基点；1 个月品种报 1.9960%，下行 0.40 个基点；3 个月品种报 2.0410%，下行 0.80 个基点。今日资金面早盘均衡稍紧，日内边际趋松，尾盘趋于均衡偏松，隔夜期限资金价格继续小幅上行。

上午发行的 3 年期、20 年期国开清发债中标收益率分别为 2.0028%、2.5552%，全场倍数分别为 2.62 倍、9.47 倍，边际倍数分别为 1.48 倍、4.77 倍；下午发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出口行债中标收益率分别为 2.0373%、2.1536%、2.3736%，全场倍数分别为 3.74 倍、3.86 倍、2.76 倍，边际倍数分别为 1.52 倍、2.03 倍、1.03 倍；发行的 10 年期[24 国开 05(增 16)]、10 年期[24 国开 16]国开债中标收益率分别为 2.2605%、2.4200%，全场倍数分别为 2.74 倍、4.78 倍，边际倍数分别为 10.70 倍、1.20 倍。国债期货全天震荡走升，主力合约全线上行。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 107.430，较上个交易日上涨 0.75%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.610，较上个交易日上涨 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.530，较上个交易日上涨 0.16%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.718，较上个交易日上涨 0.07%。债券市场交投活跃，现券收益率维持震荡，午后有所下行，截至目前，剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3220%/2.3200%，剩余期限 9.86 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2540%/2.2525%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1020，较上个交易日下调 5 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 7.2390，较上一交易日上涨 41 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2504，较上一交易日上涨 58 个基点，目前两岸汇差在 110 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 105.82，较上一交易日下跌 0.11%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui