

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

【2024-04-03】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2500 亿，此外有 800 亿国库现金定存到期，全口径资金净回笼 3280 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.6850%，下行 1.90 个基点；7 天品种报 1.8210%，下行 1.20 个基点；1 个月品种报 2.0970%，下行 1.30 个基点；3 个月品种报 2.1430%，下行 0.80 个基点。今日资金面总体宽松，短期限资金价格小幅下行。

上午发行的 20 年期国开清发债中标收益率为 2.6035%，全场倍数为 9.04 倍，边际倍数为 4.72 倍；发行的 91 天期、3 年期、10 年期国债中标收益率分别为 1.3452%、1.9856%、2.2606%，边际收益率分别为 1.4007%、2.0067%、2.2758%，全场倍数分别为 2.38 倍、3.38 倍、3.89 倍，边际倍数分别为 1.85 倍、1.42 倍、1.37 倍。国债期货全天震荡偏强，主力合约多数收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 106.390，较上个交易日上涨 0.41%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.025，较上个交易日上涨 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.120，较上个交易日上涨 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.596，较上个交易日下跌 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4060%/2.4030%，剩余期限 9.90 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2840%/2.2830%。

周三美元兑人民币中间价报 7.0949，较上个交易日下调 8 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 7.2356，较上一交易日上涨 2 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2607，较上一交易日上涨 64 个基点，目前两岸汇差在 250 个基点附近。美元指数维持震荡，现报 104.79，较上一交易日上涨 0.03%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui