

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

【2024-03-01】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2470 亿，全口径资金净回笼 2370 亿。Shibor 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 1.6940%，上行 5.50 个基点；7 天品种报 1.8060%，上行 3.10 个基点；1 个月品种报 2.0880%，下行 1.10 个基点；3 个月品种报 2.1820%，下行 1.10 个基点。今日资金面总体维持均衡，午后有所收敛，尾盘回归均衡，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的 1 年期、2 年期、7 年期进出口行债中标收益率分别为 1.6210%、2.0484%、2.4217%，全场倍数分别为 3.13 倍、2.48 倍、5.56 倍，边际倍数分别为 1.65 倍、1.14 倍、1.37 倍；发行的 91 天期、182 天期国债中标收益率分别为 1.3373%、1.4253%，边际收益率分别为 1.4169%、1.5155%，全场倍数分别为 2.76 倍、2.79 倍，边际倍数分别为 63.33 倍、1.89 倍。国债期货低开低走，主力合约全线下跌。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 106.150，较上个交易日下跌 1.16%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 103.640，较上个交易日下跌 0.43%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 102.850，较上个交易日下跌 0.28%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.466，较上个交易日下跌 0.11%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.22 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.5275%/2.5250%，剩余期限 9.74 年的国债活跃券 230026 收益率报 2.3845%/2.3800%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1059，较上个交易日上调 23 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡上行，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1985，较上一交易日上涨 55 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2132，较上一交易日上涨 62 个基点，目前两岸汇差在 150 个基点附近。美元指数维持震荡，现报 104.12，较上一交易日下跌 0.02%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui