



【2024-11-04】

今日央行开展 173 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2416 亿，资金净回笼 2243 亿。Shibor 利率全线下行，其中隔夜品种报 1.3460%，下行 1.40 个基点；7 天品种报 1.4960%，下行 1.10 个基点；1 个月品种报 1.8150%，下行 0.30 个基点；3 个月品种报 1.8780%，下行 0.10 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格下行。

下午发行的 91 天期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.2473%、1.7317%、1.8582%，全场倍数分别为 3.89 倍、3.69 倍、4.12 倍，边际倍数分别为 1.55 倍、2.11 倍、1.06 倍。国债期货全天震荡，主力合约多数收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 112.130，较上个交易日上涨 0.03%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.140，较上个交易日下跌 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.850，较上个交易日下跌 0.03%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.474，较上个交易日下跌 0.04%。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 9.50 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2150%/2.2100%，剩余期限 9.55 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1250%/2.1200%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1203，较上个交易日上调 68 点。今日美元兑在岸、离岸人民币弱势震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.0974，较上一交易日下跌 276 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1023，较上一交易日下跌 362 个基点，目前两岸汇差在 40 个基点附近。美元指数弱势震荡，现报 103.79，较上一交易日下跌 0.51%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，11 月 1 日当周三大人民币汇率指数涨跌互现，CFETS 人民币汇率指数报 99.77，环比上行 0.03；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.61，环比下行 0.03；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 93.95，环比下行 0.18。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui