

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

【2024-04-17】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，MLF 到期 1700 亿，全口径资金净回笼 1700 亿。Shibor 利率短端上行，长端下行，其中隔夜品种报 1.7230%，上行 0.80 个基点；7 天品种报 1.8160%，上行 1.10 个基点；1 个月品种报 2.0000%，下行 0.50 个基点；3 个月品种报 2.0490%，下行 0.90 个基点。今日早盘资金面均衡偏松，午后稍有收敛，尾盘恢复均衡偏松态势，短期限资金价格小幅上行。

上午发行的 28 天期、63 天期国债中标收益率分别为 1.1155%、1.2175%，边际收益率分别为 1.2918%、1.3705%，全场倍数分别为 2.54 倍、2.47 倍，边际倍数分别为 1.27 倍、7.78 倍；下午发行的 1 年期、10 年期农发债中标收益率分别位 1.6448%、2.3898%，全场倍数分别为 2.69 倍、2.94 倍，边际倍数分别为 3.02 倍、1.60 倍。国债期货全天震荡，主力合约涨跌互现。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 106.670，较上个交易日上涨 0.18%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.465，较上个交易日上涨 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.365，较上个交易日下跌 0.00%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.648，较上个交易日下跌 0.00%。债券市场交投活跃，现券收益率维持震荡，长端有所下行，截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3500%/2.3490%，剩余期限 9.86 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2675%/2.2660%。

周三美元兑人民币中间价报 7.1025，较上个交易日下调 3 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡偏弱，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2349，较上一交易日下跌 47 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2458，较上一交易日下跌 187 个基点，目前两岸汇差在 110 个基点附近。美元指数先扬后抑，现报 106.11，较上一交易日下跌 0.24%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui