

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

【2024-04-15】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购、1000 亿 MLF 操作，逆回购到期 40 亿，全口径资金净投放 980 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.7160%，下行 0.10 个基点；7 天品种报 1.7970%，下行 2.30 个基点；1 个月品种报 2.0120%，下行 1.30 个基点；3 个月品种报 2.0710%，下行 1.90 个基点。今日资金面均衡偏松，短期限资金价格小幅下行。

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 1.2574%、2.0260%、2.1477%，全场倍数分别为 3.20 倍、3.73 倍、3.44 倍，边际倍数分别为 1.22 倍、4.84 倍、1.17 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 106.170，较上个交易日上涨 0.03%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.415，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.350，较上个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.652，较上个交易日下跌 0.05%。债券市场交投活跃，现券收益率维持震荡，截至目前，剩余期限 9.73 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3850%/2.3840%，剩余期限 9.86 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2785%/2.2775%。

周一美元兑人民币中间价报 7.0979，较上个交易日下调 12 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 7.2385，较上一交易日上涨 10 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2570，较上一交易日下跌 103 个基点，目前两岸汇差在 180 个基点附近。美元指数震荡偏弱，现报 105.90，较上一交易日下跌 0.10%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，4 月 12 日当周三大人民币汇率指数全线上涨，CFETS 人民币汇率指数报 100.05，环比上涨 0.22；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.46，环比上涨 0.28；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.65，环比上涨 0.17。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui