

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

【2024-11-06】

今日央行开展 173 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4310 亿，资金净回笼 4137 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.3300%，下行 0.80 个基点；7 天品种报 1.5000%，上行 0.00 个基点；1 个月品种报 1.8080%，下行 0.30 个基点；3 个月品种报 1.8760%，下行 0.10 个基点。今日资金面整体均衡，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 28 天期、182 天期、2 年期国债中标收益率分别为 1.1482%、1.3263%、1.3706%，全场倍数分别为 2.21 倍、2.57 倍、2.70 倍，边际倍数分别为 1.08 倍、7.04 倍、1.55 倍；下午发行的 182 天期、1.0548 年期、3 年期、10 年期农发债中标收益率分别为 1.4951%、1.4401%、1.9655%、2.1989%，全场倍数分别为 2.39 倍、2.59 倍、2.90 倍、3.00 倍，边际倍数分别为 1.31 倍、2.68 倍、1.38 倍、1.01 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 112.530，较上个交易日下跌 0.06%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.320，较上个交易日持平；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.895，较上个交易日下跌 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.476，较上个交易日下跌 0.02%。债券市场交投活跃，现券收益率午后震荡上行，截至目前，剩余期限 9.70 年的国开债活跃券 240215 收益率报 2.1925%/2.1875%，剩余期限 9.55 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1275%/2.1200%。

周三美元兑人民币中间价报 7.0993，较上个交易日下调 23 点。今日美元兑在岸、离岸人民币大幅上涨，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1649，较上一交易日上涨 554 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1749，较上一交易日上涨 728 个基点，目前两岸汇差在 160 个基点附近。美元指数持续走升，现报 104.75，较上一交易日上涨 1.30%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui