

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

【2024-04-08】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金零投放零回笼。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.7110%，上行 0.30 个基点；7 天品种报 1.8150%，上行 1.00 个基点；1 个月品种报 2.0620%，下行 2.00 个基点；3 个月品种报 2.1330%，下行 0.80 个基点。今日资金面均衡偏松，短期限资金价格小幅上行。

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%、2.0727%、2.2200%，全场倍数分别为 7.56 倍、3.88 倍、3.97 倍，边际倍数分别为 1.85 倍、3.13 倍、3.70 倍。国债期货早盘震荡，午后偏强，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 106.640，较上个交易日上涨 0.15%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.110，较上个交易日上涨 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.200，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.650，较上个交易日上涨 0.03%。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 9.75 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4025%/2.4015%，剩余期限 9.88 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2820%/2.2810%。

周一美元兑人民币中间价报 7.0947，较上个交易日下调 2 点。今日美元兑在岸、离岸人民币窄幅震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2337，较上一交易日下跌 19 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2476，较上一交易日上涨 4 个基点，目前两岸汇差在 140 个基点附近。美元指数维持震荡，现报 104.39，较上一交易日上涨 0.10%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，4 月 3 日当周三人民币汇率指数全线上涨，CFETS 人民币汇率指数报 99.83，环比上涨 0.05；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.18，环比上涨 0.09；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.48，环比上涨 0.05。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui