

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

【2024-04-12】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，无逆回购到期，全口径资金净投放 20 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.7170%，下行 0.40 个基点；7 天品种报 1.8200%，上行 0.50 个基点；1 个月品种报 2.0250%，下行 1.40 个基点；3 个月品种报 2.0900%，下行 1.50 个基点。今日资金面均衡偏松，短期限资金价格小幅波动。

上午发行的 1 年期、2 年期、7 年期进出口行债中标收益率分别为 1.6103%、1.8926%、2.2939%，全场倍数分别为 2.72 倍、6.59 倍、9.84 倍，边际倍数分别为 1.16 倍、12.40 倍、6.00 倍；发行的 5 年期国债中标收益率为 2.0500%，边际收益率为 2.0700%，全场倍数为 4.37 倍，边际倍数为 1.68 倍。国债期货震荡偏强，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 106.170，较上个交易日上涨 0.26%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.395，较上个交易日上涨 0.23%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.410，较上个交易日上涨 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.708，较上个交易日上涨 0.02%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡下行，短端下行幅度较大，截至目前，剩余期限 9.74 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3980%/2.3960%，剩余期限 9.87 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2810%/2.2780%。

周五美元兑人民币中间价报 7.0967，较上个交易日下调 1 点。今日美元兑在岸、离岸人民币震荡走升，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2375，较上一交易日上涨 6 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2624，较上一交易日上涨 66 个基点，目前两岸汇差在 250 个基点附近。美元指数午后冲高，现报 105.63，较上一交易日上涨 0.33%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui