

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

【2024-04-02】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1500 亿，全口径资金净回笼 1480 亿。Shibor 利率全线下行，其中隔夜品种报 1.7040%，下行 2.40 个基点；7 天品种报 1.8330%，下行 2.40 个基点；1 个月品种报 2.1100%，下行 1.80 个基点；3 个月品种报 2.1510%，下行 0.60 个基点。今日资金面早盘均衡，日内宽松，短期限资金价格小幅下行。

上午发行的 3 年期、5 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.0441%、2.1726%、2.3672%，全场倍数分别为 4.30 倍、4.54 倍、2.42 倍，边际倍数分别为 3.11 倍、1.98 倍、2.04 倍；下午发行的 2 年期、3 年期、7 年期农发清发债中标收益率分别为 2.0136%、2.1571%、2.3741%，全场倍数分别为 4.66 倍、6.31 倍、5.12 倍，边际倍数分别为 7.32 倍、15.25 倍、1.13 倍。国债期货全天弱势震荡，主力合约全线小幅收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 106.050，较上个交易日上涨 0.22%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 103.910，较上个交易日上涨 0.12%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.050，较上个交易日上涨 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.608，较上个交易日上涨 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘下行后维持震荡，截至目前，剩余期限 9.77 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4225%/2.4205%，剩余期限 9.90 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2970%/2.2960%。

周二美元兑人民币中间价报 7.0957，较上个交易日上调 19 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天震荡偏强，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2354，较上一交易日上涨 61 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2612，较上一交易日上涨 18 个基点，目前两岸汇差在 260 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 104.99，较上一交易日上涨 0.03%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui