



【2024-03-25】

今日央行开展 500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 100 亿，全口径资金净投放 400 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7740%，上行 0.20 个基点；7 天品种报 1.8980%，上行 5.30 个基点；1 个月品种报 2.1350%，上行 0.50 个基点；3 个月品种报 2.1590%，下行 0.40 个基点。今日资金面总体均衡，短期限资金价格小幅波动。

下午发行的 3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 2.1230%、2.2641%，全场倍数分别为 4.76 倍、5.11 倍，边际倍数分别为 1.36 倍、1.39 倍。国债期货全天弱势震荡，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 105.540，较上个交易日下跌 0.26%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 103.795，较上个交易日下跌 0.09%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 102.910，较上个交易日下跌 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.526，较上个交易日下跌 0.02%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，长端小幅走升，截至目前，剩余期限 9.16 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.4550%/2.4530%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 230026 收益率报 2.3425%/2.3401%。

周一美元兑人民币中间价报 7.0996，较上个交易日下调 8 点。今日美元兑在岸、离岸人民币早盘大幅走低，日内跌幅收窄，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2084，较上一交易日下跌 199 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2510，较上一交易日下跌 252 个基点，目前两岸汇差 390 个基点附近。美元指数弱势震荡，现报 104.41，较上一交易日下跌 0.02%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，3 月 22 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 99.3，环比上涨 0.43；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 104.58，环比上涨 0.55；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.09，环比上涨 0.25。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui