



【2024-10-28】

今日央行开展 2416 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2089 亿，资金净投放 327 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.4950%，下行 1.20 个基点；7 天品种报 1.6580%，下行 4.50 个基点；1 个月品种报 1.8210%，下行 0.20 个基点；3 个月品种报 1.8840%，上行 0.10 个基点。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格小幅下行。

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 1.3886%、1.7985、1.9232%，全场倍数分别为 2.25 倍、2.65 倍、2.44 倍，边际倍数分别为 6.67 倍、3.65 倍、1.13 倍。国债期货走势分化，主力合约涨跌互现。30 年期国债期货主力合约 TL2412 收报 110.850，较上个交易日下跌 0.41%；10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.855，较上个交易日上涨 0.00%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.670，较上个交易日上涨 0.07%；2 年期国债期货主力合约 TS2412 收报 102.372，较上个交易日上涨 0.06%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，长端小幅上行，截至目前，剩余期限 9.52 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2275%/2.250%，剩余期限 9.57 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1500%/2.1400%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1307，较上个交易日上调 217 点。今日美元兑在岸、离岸人民币维持震荡偏强，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1273，较上一交易日上涨 54 基点；美元兑离岸人民币现报 7.1396，较上一交易日上涨 44 个基点，目前两岸汇差在 120 个基点附近。美元指数冲高回落，现报 104.30，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，10 月 25 日当周三大人民币汇率指数全线上行，CFETS 人民币汇率指数报 99.74，环比上行 0.55；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.64，环比上行 0.57；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.13，环比上行 0.36。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui