



【2024-03-22】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 130 亿，全口径资金净回笼 110 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.7720%，上行 0.10 个基点；7 天品种报 1.8450%，上行 1.10 个基点；1 个月品种报 2.1300%，上行 0.40 个基点；3 个月品种报 2.1630%，上行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡偏紧，随后趋于均衡偏松，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 1.6834%、2.0439%、2.3676%，全场倍数分别为 3.16 倍、3.79 倍、6.66 倍，边际倍数分别为 1.14 倍、27.00 倍、1.79 倍；发行的 91 天期、7 年期国债中标收益率分别为 1.3252%、2.2800%，边际收益率分别为 1.3926%、2.3000%，全场倍数分别为 3.14 倍、3.74 倍，边际倍数分别为 5.52 倍、6.96 倍；发行的 50 年期国债中标收益率为 2.6500%，全场倍数为 3.81 倍，边际倍数为 6.86 倍。国债期货早盘震荡，午后下行，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 105.490，较上个交易日下跌 0.76%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 103.810，较上个交易日下跌 0.25%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 102.885，较上个交易日下跌 0.17%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.512，较上个交易日下跌 0.02%。债券市场交投活跃，现券收益率震荡走升，截至目前，剩余期限 9.17 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.4400%/2.4350%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 230026 收益率报 2.3325%/2.3300%。

周五美元兑人民币中间价报 7.1004，较上个交易日上调 62 点。今日美元兑在岸、离岸人民币大幅走升，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2283，较上一交易日上涨 289 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2661，较上一交易日上涨 443 个基点，目前两岸汇差 380 个基点附近。美元指数震荡走升，现报 104.38，较上一交易日上涨 0.35%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui