



【2024-05-27】

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金零投放零回笼。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.7670%，上行 0.10 个基点；7 天品种报 1.8880%，上行 7.00 个基点；1 个月品种报 1.9040%，下行 0.10 个基点；3 个月品种报 1.9580%，上行 0.00 个基点。今日资金面整体均衡，稍显紧势，隔夜期限资金价格小幅上行。

上午发行的 91 天期、3 年期、5 年期农发债中标收益率分别为 1.5199%、2.0075%、2.1477%，全场倍数分别为 1.83 倍、2.84 倍、2.79 倍，边际倍数分别为 1.47 倍、2.81 倍、1.46 倍。国债期货早盘震荡偏弱，午后有所回升，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2409 收报 106.400，较上个交易日上涨 0.08%；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.345，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.400，较上个交易日上涨 0.00%；2 年期国债期货主力合约 TS2409 收报 101.750，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率全天震荡，短端小幅上行，长端小幅下行，截至目前，剩余期限 9.62 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.4120%/2.4100%，剩余期限 9.75 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3150%/2.3100%。

周一美元兑人民币中间价报 7.1091，较上个交易日下调 11 点。今日美元兑在岸、离岸人民币窄幅震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2446，较上一交易日下跌 1 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2587，较上一交易日下跌 30 个基点，目前两岸汇差在 140 个基点附近。美元指数震荡偏弱，现报 104.72，较上一交易日下跌 0.03%。

中国外汇交易中心今早公布数据显示，5 月 24 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 99.76，环比上涨 0.33；BIS 货币篮子人民币汇率指数报 105.37，环比上涨 0.31；SDR 货币篮子人民币汇率指数报 94.34，环比上涨 0.06。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui