

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

【2024-03-28】

今日央行开展 2500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金净投放 2480 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.7340%，下行 3.60 个基点；7 天品种报 1.9480%，下行 2.40 个基点；1 个月品种报 2.1430%，上行 0.20 个基点；3 个月品种报 2.1560%，下行 0.30 个基点。今日资金面总体均衡，不同抵押品流动性有所分化。

上午发行的 20 年期国开清发债中标收益率为 2.6181%，全场倍数为 5.81 倍，边际倍数为 4.64 倍；发行的 3 年期、5 年期、10 年期进出口行债中标收益率分别为 2.0074%、2.2557%、2.4426%，全场倍数分别为 5.34 倍、5.15 倍、2.71 倍，边际倍数分别为 2.24 倍、1.11 倍、1.00 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.2012%、2.3566%，全场倍数分别为 4.25 倍、2.81 倍，边际倍数分别为 2.00 倍、13.48 倍。国债期货午盘走升，尾盘回落，主力合约多数收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 105.830，较上个交易日上涨 0.15%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 103.900，较上个交易日下跌 0.00%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.040，较上个交易日上涨 0.00%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.582，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，截至目前，剩余期限 9.15 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.4500%/2.4475%，剩余期限 9.66 年的国债活跃券 230026 收益率报 2.3400%/2.3350%。

周四美元兑人民币中间价报 7.0948，较上个交易日上调 2 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天窄幅震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2279，较上一交易日下跌 5 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2584，较上一交易日上涨 43 个基点，目前两岸汇差在 310 个基点附近。美元指数午后走升，现报 104.58，较上一交易日上涨 0.27%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui