



【2024-03-07】

今日央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1170 亿，全口径资金净回笼 1070 亿。Shibor 利率多数下行，其中隔夜品种报 1.7130%，上行 0.00 个基点；7 天品种报 1.8270%，上行 0.50 个基点；1 个月品种报 2.0880%，上行 0.00 个基点；3 个月品种报 2.1640%，下行 0.10 个基点。今日资金面总体均衡，尾盘趋于均衡偏松，短期限资金价格小幅波动。

上午发行 20 年期国开债中标收益率为 2.4738%，全场倍数为 5.61 倍，边际倍数为 3.18 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 2.0640%、2.2221%、2.3755%，全场倍数分别为 6.79 倍、4.46 倍、4.50 倍，边际倍数分别为 1.25 倍、2.74 倍、1.67 倍；下午发行的 3 年期、10 年期国开债中标收益率分别为 2.2321%、2.3116%，全场倍数分别为 7.40 倍、2.43 倍，边际倍数分别为 3.49 倍、6.73 倍。国债期货高开低走，主力合约全线收跌。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 107.190，较上个交易日下跌 0.07%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 104.125，较上个交易日下跌 0.06%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.035，较上个交易日下跌 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.450，较上个交易日下跌 0.06%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘走高，午后涨幅有所回落，曲线整体上行，截至目前，剩余期限 9.21 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.4000%/2.3950%，剩余期限 9.72 年的国债活跃券 230026 收益率报 2.2925%/2.2850%。

周四美元兑人民币中间价报 7.1002，较上个交易日下调 14 点。今日美元兑在岸、离岸人民币维持窄幅震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.1986，较上一交易日下跌 6 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2106，较上一交易日上涨 3 个基点，目前两岸汇差在 120 个基点附近。美元指数震荡下行，现报 103.24，较上一交易日下跌 0.12%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui