

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

【2024-03-26】

今日央行开展 1500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 50 亿，此外有 500 亿国库现金定存到期，全口径资金净投放 950 亿。Shibor 利率多数上行，其中隔夜品种报 1.7700%，下行 0.40 个基点；7 天品种报 1.9570%，上行 5.90 个基点；1 个月品种报 2.1370%，上行 0.20 个基点；3 个月品种报 2.1600%，上行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡，尾盘偏松，隔夜期限资金价格小幅下行。

上午发行的 3 年期、5 年期、10 年期国开债中标收益率分别 2.0965%、2.2156%、2.3802%，全场倍数分别为 2.82 倍、2.86 倍、3.43 倍，边际倍数分别为 58.33 倍、1.22 倍、2.19 倍；下午发行的 2 年期、7 年期农发清发债中标收益率分别为 2.0145%、2.3576%，全场倍数分别为 5.26 倍、5.53 倍，边际倍数分别为 1.36 倍、1.67 倍。国债期货全天震荡，主力合约多数收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 105.360，较上个交易日上涨 0.00%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 103.765，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 102.945，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.562，较上个交易日上涨 0.03%。债券市场交投活跃，现券收益率涨跌互现，截至目前，剩余期限 9.16 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.4625%/2.4600%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 230026 收益率报 2.3510%/2.3500%。

周二美元兑人民币中间价报 7.0943，较上个交易日下调 53 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天震荡，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2194，较上一交易日上涨 110 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2479，较上一交易日下跌 51 个基点，目前两岸汇差 290 个基点附近。美元指数弱势震荡，现报 104.14，较上一交易日下跌 0.09%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui