



【2024-03-27】

今日央行开展 2500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 30 亿，全口径资金净投放 2470 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 1.7700%，上行 0.00 个基点；7 天品种报 1.9720%，上行 1.50 个基点；1 个月品种报 2.1410%，上行 0.40 个基点；3 个月品种报 2.1590%，下行 0.10 个基点。今日资金面总体均衡偏松，隔夜期限资金价格小幅下行。

下午发行的 1 年期、10 年期农发清发债中标收益率分别为 1.6235%、2.4472%，全场倍数分别为 3.47 倍、4.61 倍，边际倍数分别为 67.00 倍、4.37 倍。国债期货全天震荡，尾盘拉升，主力合约全线收涨。30 年期国债期货主力合约 TL2406 收报 105.820，较上个交易日上涨 0.44%；10 年期国债期货主力合约 T2406 收报 103.910，较上个交易日上涨 0.13%；5 年期国债期货主力合约 TF2406 收报 103.060，较上个交易日上涨 0.11%；2 年期国债期货主力合约 TS2406 收报 101.576，较上个交易日上涨 0.01%。债券市场交投活跃，现券收益率早盘震荡，午后下行，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 2.3325%/2.3250%。

周三美元兑人民币中间价报 7.0946，较上个交易日上调 3 点。今日美元兑在岸、离岸人民币全天震荡偏强，截至 16:30，美元兑在岸人民币收报 7.2284，较上一交易日上涨 90 个基点；美元兑离岸人民币现报 7.2560，较上一交易日上涨 72 个基点，目前两岸汇差在 260 个基点附近。美元指数震荡偏强，现报 104.37，较上一交易日上涨 0.07%。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ryan Rui