

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20170727】在岸人民币汇率创新高

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/07/27

央行今日公开市场进行 600 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 400 亿，资金净投放 200 亿。Shibor 利率涨多跌少，其中隔夜品种报 2.7860%，上涨 6.10 个基点；7 天品种报 2.8626%，上涨 1.36 个基点；1 个月品种报 3.8994%，下跌 0.92 个基点；3 个月品种报 4.2500%，下跌 0.10 个基点。今日资金面早盘维持偏紧态势，隔夜资金需求较大，融出有限；7 天资金需求较大，但融出多为高价；14 天及以上融出较多、需求较少、成交较少。

统计局今早公布数据显示，中国 6 月规模以上工业企业利润同比 19.1%，高于前值的 16.7%；1-6 月规模以上工业企业利润同比增长 22%，至 3.63 万亿元，较 1-5 月同比增速放缓 0.7 个百分点。

今早发行的 3 年期、5 年期进出口行固息增发债加权中标收益率分别为

3.9759%、4.1130%，全场倍数分别为 2.85、2.22 倍，边际倍数分别为 1.17、4.50 倍。下午发行的 3 年期、7 年期国开行固息增发债中标收益率分别为 3.9510%、4.2111%，全场倍数分别为 4.36、3.41 倍，边际倍数分别为 14.46、1.43 倍。今日国开债招标结果总体较好，机构投标热情旺盛，上午发行的进出口债招标结果较弱，全场倍数一般。

国债期货早盘高开低走，午后大幅拉升收高。10 年期国债期货主力合约 T1709 收报 95.050，涨 0.14%，5 年期国债期货主力合约 TF1709 收报 97.530，涨 0.00%。债券市场走势胶着，现券收益率窄幅震荡，午后有所下行，截至目前，剩余期限 9.71 年的国开债活跃券 170210 收益率报 4.20%/4.195%；剩余期限 9.78 年的国债活跃券 170010 收益率报 3.60%/3.595%。昨日美联储 FOMC 利率声

明偏鸽，今日央行公开市场小幅净投放，但特别国债续发存在不确定性，多空交织，债市走势胶着。

周四人民币兑美元中间价报 6.7307，较上个交易日大幅上调 222 点，创近一个月最大升幅，中间价升至 2016 年 10 月以来最高。在岸人民币兑美元大幅上涨，期间突破 6.74、6.73 关口，随后逐渐回吐涨幅，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.7376，较上一交易日收盘价大幅上涨 169 点；离岸人民币兑美元现

报 6.7331，较上一交易日收盘价上涨 103 点，两岸汇差目前倒挂在 35 点附近。美元指数震荡回升，现报 93.51，较上一交易日收盘价涨 0.05%。

以上仅供参考，谢谢！

如果您对本文有任何评论和见解

请发电邮至：shmarketing@cfets-nex.com.cn

更多信息，请登录网站：www.cfets-nex.com.cn

免责声明 文中信息均来源于公开资料，上海国际货币经纪有限责任公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，内容和意见仅供参考。本文仅反映作者个人观点，并不代表公司的看法。