

市场概述 Market Overview

【每日市场动态 20170927】跨季资金延续紧势

文/ Ryan Rui

CFETS-NEX 2017/09/27

今日央行公开市场暂停逆回购操作，逆回购到期 400 亿，资金净回笼 400 亿。Shibor 利率全线上涨，其中隔夜品种报 2.8630%，上涨 2.60 个基点，创近一个月新高；7 天品种报 2.9494%，上涨 2.03 个基点；1 个月品种报 4.0174%，上涨 1.12 个基点；3 个月品种报 4.3565%，上涨 0.07 个基点。今日资金面依旧维持紧平衡态势，早盘隔夜资金供给有限，午后机构融出开始增多，逐渐趋于均衡；跨季资金全天偏紧，仅非银高价融出，午后未有明显缓解。

国家统计局今早公布中国 8 月规模以上工业企业利润同比 24%，创 2013 年以来最大增幅，前值为 16.5%；1-8 月规模以上工业企业利润同比 21.6%，前值为 21.2%。统计局解读称，工业产品价格上升，企业生产成本降低，工业利润增速加快；企业杠杆率明显降低，利润率显

著提高。

国债期货全天维持弱势震荡，多数收跌，10 年期国债期货主力合约 T1712 收报 95.160，跌 0.04%，5 年期国债期货主力合约 TF1712 收报 97.625，跌 0.02%。现券收益率窄幅波动，变化不大，截至目前，剩余期限 9.92 年的国开债活跃券 170215 收益率报 4.2175%/4.215%；剩余期限 9.86 年的国债活跃券 170018 收益率报 3.62%。

周三人民币兑美元中间价报 6.6192，较上个交易日下调 116 点，连续第三天下调。在岸人民币兑美元维持弱势震荡格局，截至 16:30，在岸人民币兑美元报收 6.6350，较上一交易日收盘价下挫 45 点，再创一个月新低；离岸人民币兑美元早盘窄幅震荡，午后大幅下挫，现报 6.6372，较上一交易日收盘价下跌 90 点，两岸汇差目前在 14 点附近。美元指数全

天震荡上行现报 93.45，较上一交易日收盘价大幅上涨 0.49%。

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。