



【2021-10-27】

今日央行开展 2000 亿 7 天期逆回购、700 亿 2 个月国库现金定存操作，有 1000 亿逆回购、700 亿国库现金定存到期，当日全口径资金净投放 1000 亿。Shibor 利率全线上行，其中隔夜品种报 1.9210%，上涨 37.50 个基点；7 天品种报 2.2680%，上涨 0.60 个基点；1 个月品种报 2.3920%，上涨 0.50 个基点；3 个月品种报 2.4450%，上涨 0.20 个基点。今日资金面整体均衡偏松，大行国股有部分融出。

今日国家统计局公布了 2021 年 9 月及前三季度工业企业利润情况，数据显示，9 月份，规模以上工业企业实现利润总额 7387.4 亿元，同比增长 16.3%；1—9 月份，全国规模以上工业企业实现利润总额 63440.8 亿元，同比增长 44.7%

今日上午发行的 1 年期附息国债、10 年期附息续发国债中标利率分别为 2.2200%、2.9357%，边际利率为 2.2700%、2.9564%，全场倍数分别为 3.66 倍、4.59 倍，边际倍数分别为 1.05 倍、1.10 倍。下午发行的 1 年期农发行固息债、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.2500%、3.3672%，全场倍数分别为 4.19 倍、3.41 倍，边际倍数分别为 6.16 倍、2.88 倍。国债期货早盘冲高后震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2112 收报 99.150，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2112 收报 100.650，较上个交易日下跌 0.02%；2 年期国债期货主力合约 TS2112 收报 100.640，较上个交易日上涨 0.01%。今日现券收益率窄幅震荡。截至目前，剩余期限 9.61 年的国开债活跃券 210210 收益率报 3.339%/3.338%，剩余期限 9.58 年的国债活跃券 210009 收益率报 2.9775%/2.9725%。

周三美元兑人民币中间价报 6.3856，较上个交易日下调 34 点。今日在岸、离岸美元兑人民币早盘快速上行，随后高位震荡，下午 4：00 后再度大幅上行，截至 16:30，在岸美元兑人民币收报 6.3934，较上一交易日升值 122 个基点；离岸美元兑人民币现报 6.3901，较上一交易日升值 118 个基点，目前两岸汇差倒挂在 33 个基点附近。美元指数震荡下行，下午 4:00 后快速上行，跌幅收窄，现报 93.95，与上个交易日基本持平。

以上仅供参考，谢谢！

文/Jason Mao

如果您对本文有任何评论与见解
请发电邮至：SHResearch@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松查看晨报及更多资讯



免责声明：
文中信息均来自公开资料，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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN