



【2020-07-27】

今日央行开展 1000 亿元逆回购操作，有 1000 亿元逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率全数上涨，其中隔夜品种报 1.9940%，较上个交易日上涨 15.10 个基点；7 天品种报 2.2020%，较上个交易日上涨 5.50 个基点；1 个月品种报 2.2580%，较上个交易日上涨 1.30 个基点；3 个月品种报 2.5740%，较上个交易日上涨 1.70 个基点。今日资金面呈现均衡偏松态势，早盘大行谨慎融出隔夜期限，市场供给整体充裕；跨月期限融出成交较少，午后资金面趋于宽松直至收盘。

今日国家统计局发布数据，1—6 月份，全国规模以上工业企业实现利润总额 25114.9 亿元，同比下降 12.8%，降幅比 1—5 月份收窄 6.5 个百分点。

今日午后发行的 3 年期、5 年期、10 年期农发行固息增发债中标利率分别为 2.9794%、3.2087%、3.3279%，全场倍数分别为 4.68 倍、5.79 倍、7.47 倍，边际倍数分别为 1.36 倍、2.26 倍、2.25 倍。国债期货全天低位震荡，10 年期国债期货主力合约 T2009 收报 99.855，较上个交易日下跌 0.10%，5 年期国债期货主力合约 TF2009 收报 101.295，较上

个交易日下跌 0.05%；2 年期国债期货主力合约 TS2009 收报 100.930，较上个交易日下跌 0.03%。今日现券收益率小幅上行。截至目前，剩余期限 9.62 年的国开债活跃券 200205 收益率报 3.3825%/3.3750%，剩余期限 9.82 年的国债活跃券 200006 2.880%/2.875 %。

周一人民币兑美元中间报价 7.0029，较上个交易日下调 91 点。在岸人民币兑美元全天高位震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 7.0010，较上个交易日官方收盘价上涨 152 点。离岸人民币兑美元早盘走高，午后维持震荡，现报 7.0036，较上个交易日收盘价上涨 135 点，目前两岸汇差在 26 点附近。美元指数大幅走低，午后小幅回升，现报 93.94，较上个交易日下跌 0.42%。

上周最后一个交易日（7 月 24 日）CFETS 人民币汇率指数录得 92.17，按周下跌 0.56；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 95.90，按周下跌 0.61；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 90.56，按周下跌 0.62。

以上仅供参考，谢谢！

文/Julia Ji

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