



【2019-01-02】

今日央行公开市场进行 300 亿 7 天期、100 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1100 亿，资金净回笼 700 亿元。Shibor 利率全线下跌，其中隔夜品种报 2.3000%，下跌 25.40 个基点；7 天品种报 2.6340%，下跌 26.90 个基点；1 个月品种报 3.2000%，下跌 27.20 个基点；3 个月品种报 3.2850%，下跌 6.10 个基点。今日资金面宽松，早盘银行加权融出隔夜，午后减点融出增加，7 天、14 天期限成交有限，部分基金融出跨春节资金，部分银行有跨春节资金需求，但成交不多。

今日公布的 2018 年 12 月财新中国制造业 PMI 为 49.7，较上月下行，2017 年 5 月以来首次落入收缩区间，其中新订单总量出现 2016 年 7 月以来首次下降，新出口订单连续九个月下降，用工规模已连续 62 个月呈收缩状态。

今日发行的 3 年期、7 年期附息国债加权中标利率分别为 2.7358%、3.0461%，边际中标利率分别为 2.7754%、3.1131%，全场倍数分别为 2.45 倍、2.96 倍，边际倍数分别为 1.35 倍、5.31 倍。早盘国债期货小幅高开后快速拉升，全天震荡上行，午后涨幅扩大。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 98.105，较上个交易日上涨 0.40%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.600，较上个交易日上涨 0.22%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.330，较上个交易日上涨 0.07%。受节后资金面宽松、经济数据表现不佳等因素影响，今日债市做多情绪高涨，现券收益率震荡下行。截至目前，剩余期限 9.51 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.61%/3.605%，剩余期限 9.62 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.19%/--%。

周三人民币兑美元中间价报 6.8482，较上个交易日上调 150 点。在岸人民币兑美元早盘上行，午盘起维持震荡，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.8518，较上一交易日官方收盘价上涨 140 点；离岸人民币兑美元早盘小幅下行，午盘拉升，午后有所回落，现报 6.8652，较上一交易日上涨 106 点，两岸汇差目前在 134 点附近。美元指数早盘震荡走强，午后跳水，随后大幅反弹，现报 96.1965，较上一个交易日上涨 0.08%。

上周五（12 月 28 日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.28，按周上涨 0.37；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.78，按周上涨 0.35，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 93.14，按周上涨 0.32。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ellen Liu

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