

市场概述 每日市场动态

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2019-01-21】

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，不开展逆回购操作，逆回购到期 800 亿，资金净回笼 800 亿。Shibor 利率涨跌互现，其中隔夜品种报 2.2400%，上涨 6.15 个基点；7 天品种报 2.5940%，下跌 2.40 个基点；1 个月品种报 2.7860%，上涨 0.90 个基点；3 个月品种报 2.9150%，下跌 0.30 个基点。今日早盘隔夜加权融出，午后隔夜资金面略有收紧，趋于均衡，7 天期限加权融出、需求不多，14 天、21 天融出兴趣浓厚，但需求有限。

今日国家统计局公布一批经济数据，中国 2018 年 GDP 同比 6.6%，与预期持平，2017 年 GDP 同比 6.8%；四季度 GDP 同比 6.4%，持平预期，增速为约十年新低。中国 12 月社会消费品零售总额同比 8.2%，高于预期，终结连续 2 月下滑态势，其中食品分类增速最快，全年社会消费品零售总额同比 9%，较去年下行。2018 年固定资产投资增长 5.9%，低于预期，增速与前 11 个月持平，较上年回落 1.3 个百分点。12 月规模以上工业增加值同比增长 5.7%，高于预期和前置，其中汽车连续第六个月负增长，规模以上工业增加值同比 6.2%。

今日发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债中标利率分别为 3.0314%、3.2771%，全场倍数分别为 3.97 倍、3.50 倍，边际倍数分别为 20 倍、1.33 倍。国债期货早盘低开高走，经济数据公布后跳水，随后维持弱势震荡至尾盘。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.96，较上个交易日下跌 0.18%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.72，较上个交易日下跌 0.10%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.545，较上个交易日下跌 0.07%。受经济数据未超预期下行、股票市场走高等因素影响，现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.45 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.6275%/3.625%。

周一人民币兑美元中间价报 6.7774，较上个交易日下调 109 点。在岸人民币兑美元低开低走，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7901，较上一交易日官方收盘价下跌 195 点；离岸人民币兑美元早盘冲高回落，午后小幅震荡，现报 6.7994，较上一交易日官方收盘价上涨 32 点，目前两岸汇差在 93 点附近。美元指数全天震荡下行，尾盘拉升，现报 96.28，较上一交易日下跌 0.09%。

上周五（1 月 18 日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.87，按周上涨 0.52；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.45，按周上涨 0.66，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.23，按周上涨 0.59。

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