

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

【2019-01-14】

今日央行公开市场进行 800 亿元 7 天期、200 亿元 28 天期逆回购操作，逆回购到期 800 亿，资金净投放 200 亿元。Shibor 利率短端上涨、长端下跌，其中，隔夜品种报 1.8780%，上涨 17.00 个基点；7 天品种报 2.6290%，上涨 7.40 个基点；1 个月品种报 2.7750%，上涨 0.30 个基点；3 个月品种报 2.9840%，下跌 2.30 个基点。今日资金面总体宽松，早盘隔夜至跨春节期限均融出充足，大行加权融出隔夜，临近午盘资金融出有所减少，午后大行融出依旧较少，资金面相对偏紧，三点后资金面转松。

海关总署公布数据显示，中国 12 月进口同比(按美元计) -7.6%，创 2016 年 7 月以来最大降幅，中国 12 月出口同比(按美元计) -4.4%，创 2016 年 12 月以来最大降幅，双双不及预期和前值，12 月贸易帐(按美元计) 顺差 570.6 亿美元，为 2015 年 12 月以来新高。

今早发行的 3 年期、5 年期农发行固息增发债加权中标利率分别为 3.071%、3.3068%，全场倍数分别为 3.86 倍、3.22 倍，边际倍数分别为 1.01 倍、2.85 倍，一级需求不俗。国债期货早盘高开跳水，随后全天维持弱势震荡。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.845，较上个交易日下跌 0.16%；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.550，较上个交易日下跌 0.09%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.450，较上个交易日上涨 0.03%。今日现券收益率震荡上行，截至目前，剩余期限 9.47 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.6075%/3.605%，剩余期限 9.59 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.135%。

周一人民币兑美元中间价报 6.7560，较上个交易日上调 349 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘拉升，随后受贸易数据不及预期影响双双回落，临近尾盘温和回升，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7578，较上一交易日官方收盘价下跌 96 点；离岸人民币兑美元现报 6.7665，较上一交易日官方收盘价下跌 56 点。美元指数早盘下行，午后小幅冲高回落，现报 95.65，较上一交易日下跌 0.02%。

上周五(1 月 11 日) CFETS 人民币汇率指数录得 93.35，按周上涨 0.32；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 96.79，按周上涨 0.37，参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 93.64，按周上涨 0.57。

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