

# 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

【2019-01-28】

今日央行发布公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，可吸收现金投放、政府债券发行缴款等因素的影响，不开展逆回购操作，今日无逆回购到期，资金零投放零回笼。Shibor 利率跨春节期限上涨、其余期限下跌，其中隔夜品种报 2.1940%，下跌 16.80 个基点；7 天品种报 2.6600%，上涨 3.40 个基点；1 个月品种报 2.8280%，上涨 0.90 个基点；3 个月品种报 2.9010%，下跌 0.10 个基点。今日资金面总体宽松，隔夜全天维持宽松状态，7 天、14 天跨春节资金融出充裕、需求较上周有所增加，需求较快满足，21 天及以上期限以融出为主。

今日国家统计局公布数据显示，2018 年 12 月份规模以上工业企业实现利润总额 6808.3 亿元，同比下降 1.9%，降幅比 11 月份扩大 0.1 个百分点，本年度连续第八个月下滑，创下自 2015 年 12 月以来的最大降幅。全年同比增长 10.3%，增速比 1-11 月份放缓 1.5 个百分点。具体来看，国有企业利润增速继续下降，石油开采、矿物制品、金属冶炼成为新增利润的主要来源。

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 3.0532%、3.3310%，全场倍数分别为 3.14 倍、2.93 倍，边际倍数分别为 1.82 倍、1.14 倍。国债期货低开低走，午后反弹翻红，尾盘回落。10 年期国债期货主力合约 T1903 收报 97.680，较上个交易日持平；5 年期国债期货主力合约 TF1903 收报 99.650，较上个交易日上涨 0.06%；2 年期国债期货主力合约 TS1903 收报 100.405，较上个交易日持平。债券市场高开后维持震荡，全天交投谨慎，截至目前，剩余期限 9.44 年的国开债活跃券 180210 收益率报 3.685%/3.68%，剩余期限 9.55 年的国债活跃券 180019 收益率报 3.155%/--%。

周一人民币兑美元中间价报 6.7472，较上个交易日上调 469 点。在岸、离岸人民币兑美元早盘双双快速拉升，在岸人民币兑美元全天弱势震荡，离岸人民币兑美元震荡走弱，截至 16:30，在岸人民币兑美元收报 6.7389，较上一交易日官方收盘价上涨 251 点；离岸人民币兑美元现报 6.7504，较上一交易日官方收盘价上涨 27 点，目前两岸汇差在 115 点附近。美元指数先降后升，现报 95.90，较上一交易日上涨 0.09%。

上周五（1 月 25 日）CFETS 人民币汇率指数录得 93.78，按周下跌 0.09；参考 BIS 货币篮子的人民币汇率指数录得 97.37，按周下跌 0.08；参考 SDR 货币篮子的人民币汇率指数录得 94.05，按周下跌 0.18。

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**