

冠力日参：俄罗斯央行暂停在市场上购买外汇

报告日期：2022/1/25

市场简报

亚洲股市周一涨跌互见，投资者准备迎接美联储会议，预计该局将在会议上确认，将很快开始收回近年来为成长型股票带来动力的大量流动性。恒生指数下跌 1.24%，上证指数上涨 0.04%，日经 225 上涨 0.24%。

对俄罗斯可能袭击乌克兰的担忧削弱了市场情绪，同时投资者正为美联储本周的会议做准备，因此欧洲股市周一收低，科技股的跌幅最大。FTSE100 下跌 2.63%，DAX 下跌 3.8%，法国 CAC40 下跌 3.97%。

美国股市周一方面，波动率指数飙升，尾盘在抄底资金推动下，一度创下近两年最大跌幅的股市收复所有失地，零售，工业和能源类股领涨。道琼工业指数上涨 0.29%，标普 500 指数上涨 0.28%。

大宗商品方面，布伦特原油下跌 0.86%，黄金上涨 0.42%，比特币上涨 0.37%。

最新快讯

- 拜登与欧洲首脑试图达成应对俄罗斯的统一立场。乌克兰政府估计俄罗斯十余万大军压境，五角大楼表示 8,500 名美军随时准备驰援北约部队。
- 克里姆林宫：乌克兰军队在顿巴斯发动攻势的风险“极高”。
- 澳洲通知在乌克兰境内的本国公民立刻离境，大使馆人员家属将在几天内撤离。
- 利率交易员预测美股下跌不会让美联储暂缓紧缩，3 月加息已箭在弦上。
- 受 omicron 疫情的影响，美国 1 月初商业活动接近停滞，产能限制挥之不去，需求受到遏制。
- 美联储会议前夕美元多头收缩战线，根据商品期货交易委员会(CFTC)数据，美元兑主要货币的投机性净多头头寸创下 2020 年 6 月以来最大降幅。



冠力资产管理有限公司，为香港证监会持牌注册法团，中央编码 BEL573，从事第 4 类就证券提供意见和第 9 类提供资产管理受规管活动。

香港办公室：香港湾仔湾仔道 83 号 16 层

关注冠力金融微信公众号：



Zihan Shang

(852) 2768 3832

zihan.shang@grandlyifg.com

Mingpong Tse

(852) 2768 3831

bonn.tse@grandlyifg.com

- 货币市场将欧洲央行加息 10 个基点的时点预测从 10 月推后至 12 月。
- 卢布贬值迫使俄罗斯央行两年多来首次停止购买外汇，以减少金融市场波动。
- 供应链瓶颈初步缓和，德国和法国 1 月份制造业活动扩张。
- 伊朗称，如果有望就达成一份“良好的”核协议取得重大进展，伊朗将考虑直接与美国接触。
- IBM 第四财季营收同比增长 6.5%，超过分析师预估。
- 辉瑞和 BioNTech：研究证实三剂疫苗可中和 omicron 变异株。

图表 1：全球重要市场指标

冠力国际		全球重要市场指标		2022年1月24日	
股票	昨收盘价	涨跌幅	商品	昨收盘价	涨跌幅
道琼斯指数	34364.5	0.29%	彭博商品指数	104.6155	-0.71%
标普500	4410.1	0.28%	布伦特原油	87.13	-0.86%
欧洲斯托克50	4054.4	-4.14%	黄金	1843.06	0.42%
英国FTSE100	7297.15	-2.63%	比特币	36828.36	0.37%
德国DAX	15011.13	-3.80%	汇率	昨收盘价	涨跌幅
法国CAC40	6787.79	-3.97%	美元指数	95.891	0.26%
日经225	27588.4	0.24%	欧元美元	1.1326	-0.16%
恒生指数	24656.5	-1.24%	美元人民币	6.3308	-0.12%
上证指数	3524.1	0.04%	港币人民币	0.81314	-0.12%
深证成指	14081.79	0.37%	利率/债券	昨收盘价	涨跌幅
A50	15408.2	-0.34%	3m SHIBOR	2.465	-0.1bp
MSCI世界指数	3025.1	0.00%	3m LIBOR	0.25771	0bp
VIX	29.9	1.1	美国10年利率	1.7706	1.25bp

来源：冠力资产

图表 2：全球重要数据/事件

时间 (北京)	国家	数据/事件
17:00	德国	1月Ifo企业信心指数 (预估为94.5, 前值为94.7)
22:00	美国	11月FHFA房价指数环比 (预估为1%, 前值为1.1%)
23:00	美国	1月里士满联储制造业指数 (预估为14, 前值为16)
23:00	美国	1月世界大型企业研究会消费者信心指数 (预估为111.2, 前值为115.8)

来源：冠力资产

重要说明：本报告中提供的资讯和意见，由冠力资产管理有限公司向现在及潜在客户提供，并且以合理谨慎的原则编制，所用资料、资讯或资源均于出版时为真实和可靠的。报告中意见仅为在发表之日的即时意见。本报告所载的信息和意见如有变更，恕不另行通知。冠力资产管理有限公司没有义务更新这份研究报告。冠力资产管理有限公司对本报告或任何其内容的准确性或完整性或其他方面，无论明示或暗示，无作出任何陈述或保证。冠力资产管理有限公司，冠力金融服务有限公司，冠力国际金融集团有限公司，及其或其各自的董事，管理人员，合伙人，代表或雇员并不承担由于使用本报告的责任投资者应该审慎考虑本研究报告中详述的金融工具是否适合投资者的财务状况、投资目标和经验、风险承受能力和其他有关情况。本材料中任何内容不得(i)抄袭、复印或复制于任何形式、任何方式；或(ii)未经冠力资产管理有限公司书面同意转载与再发布。

披露：此研究报告由「冠力资产管理有限公司」的持牌人撰写，「冠力资产管理有限公司」为香港证监会持牌注册法团，从事第 4 类就证券提供意见和第 9 类提供资产管理受规管活动。本报告不构成任何签订协议的邀请或要约，所载全部资料仅供参考。本报告所表达的意见反映了「冠力资产管理有限公司」的意见。根据证券及期货事务监察委员会持牌或注册人士的操守守则，持牌人（及其关联人）确认未在下列情形下处置或交易本报告中所述金融产品 i) 与本研究报告相悖；ii) 自本报告之日三十日前或未来三交易日内。此外，所有持牌人（及其关联人）涉及本报告所述金融产品的情形已于表格 1 中披露。如所述金融产品为证券，持牌人（及其关联人）不存在与证券关联公司的雇佣关系。持牌人（及其关联人）不会因本报告所表达的具体建议或意见直接或间接的获取报酬。