

# 首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200226

## 货币市场

1. 资金面宽松，市场净操作为 0。银行间体系流动性总量处于合理充裕水平。
2. 全天保持宽松格局，隔夜回购利率 1.58, 7 天回购利率 2.07。均处于低位。

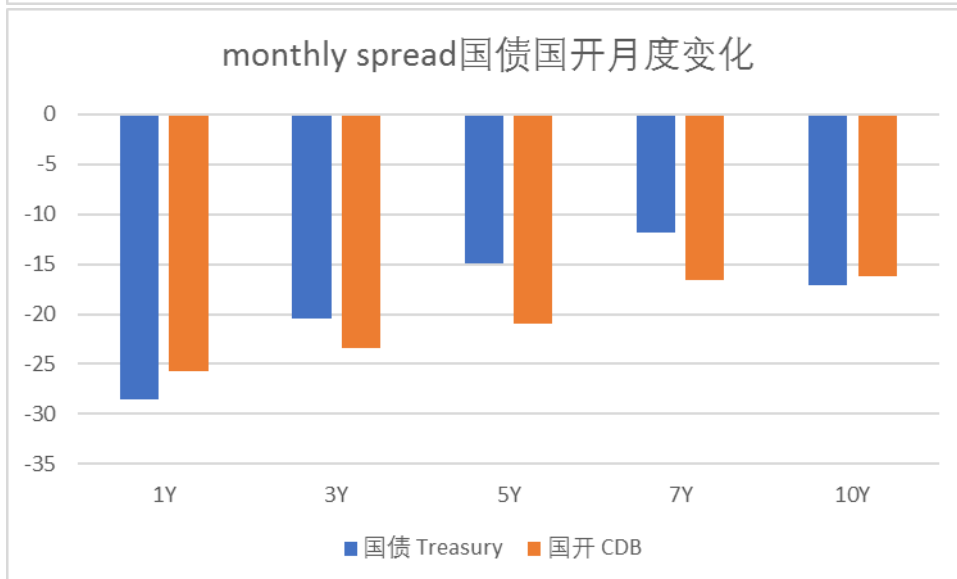
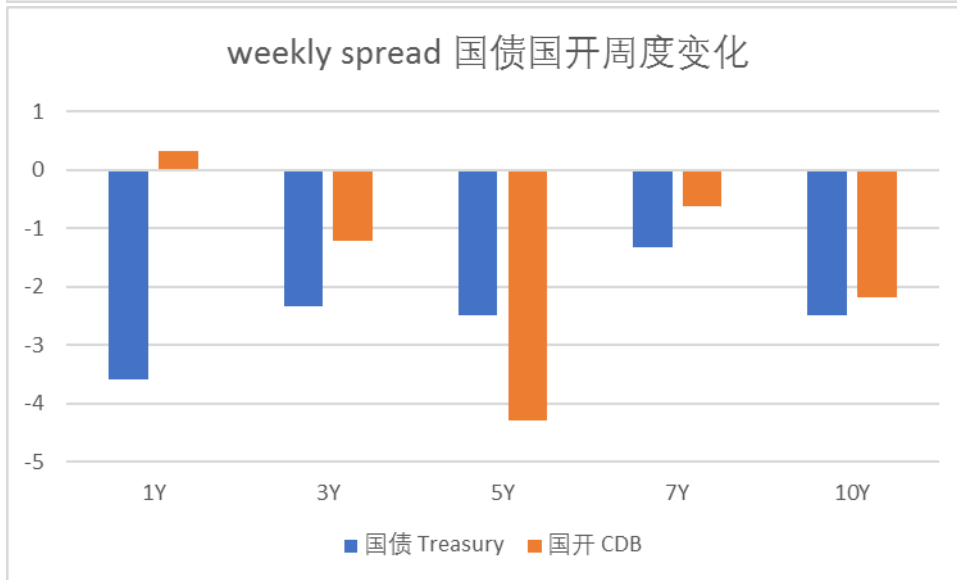
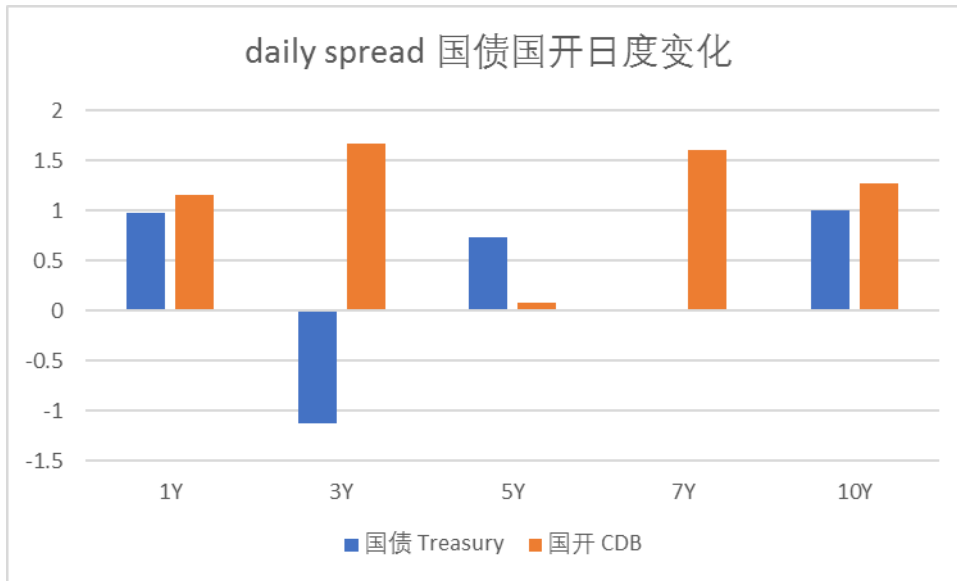
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.58	7	24	-79	29371	1%
7天	2.07	7	-1	-47	4593	-6%
14天	2.00	-6	-4	-78	647	-27%
1月	-	-206	-	-273	20	-58%
3月	2.45	4	35	-8	35	1702%

Shbor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.60	7	25	-84
7天	2.20	3	-4	-35
14天	2.08	-2	-3	-71
1月	2.32	-1	-2	-50
3月	2.46	-2	-3	-40

数据来源：Wind

## 债券

1. 避险情绪缓和，黄金下跌，美股和 A 股上涨。在避险情绪和股市强势拉升下，债市小幅回调。10 年国债国开均小幅回升 1-2bp。
2. 国债期货全天震荡，十年国债二次探底 2.80 位置之际，市场继续在当前位置震荡。
3. 李克强主持国务院常务会议，确定增加再贷款再贴现 5000 亿，用于中小银行加大对中小微企业支持。下调支农、支小再贷款利率 0.25 个百分点。继 2 月初的 3000 亿专项再贷款主要定点疫情相关行业之后，本次扶持重点有所变化。



数据来源：Wind

## 汇率

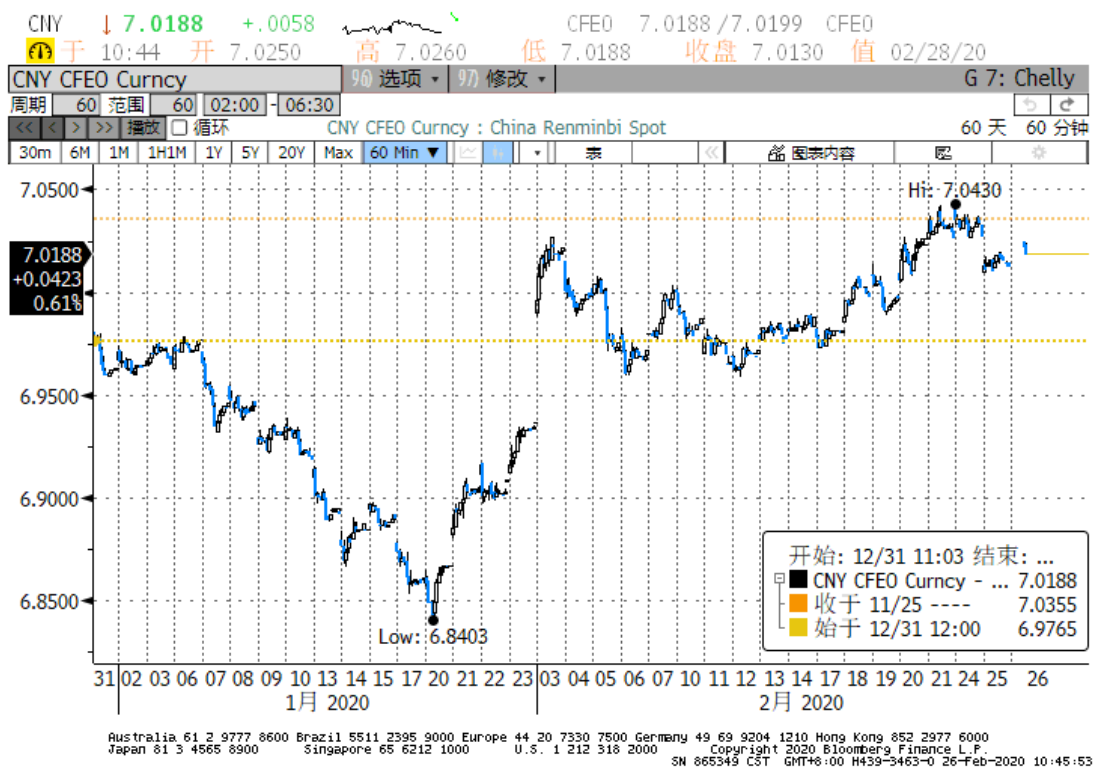
周二人民币兑美元中间价报 7.0232，较上日小幅调升 14 点。境内外人民币于盘初反弹逾百点之后，日内多数时间供求基本平衡，价格保持横向窄幅盘整。彭博模拟的实时人民币一篮子指数也继续小幅走升，反映人民币升势略超其他非美货币。16:30 境内人民币收盘报 7.0162，较上一交易日大幅收升 153 点。

新冠疫情全球蔓延之际，美元后市预计依旧看涨，人民币兑美元仍没有大幅反弹空间，今日亚市早盘离岸人民币回落至 7.03 附近。

美元兑人民币 2020 年 02 月 25 日日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/02/25



美元兑人民币 2020 年年初至今每日走势 USDCNY daily trend since 2020



数据来源 : Bloomberg

免责声明 : 本文所引述机构或个人的观点、言论、数据及其他信息仅作参考和资讯传播之目的, 如发现违法或不良信息请与联系人沟通, 我们将及时处理。

金融市场部联系人 :

张佳璐 电话 : 021-60934495 邮箱 : [zhangjialu@metrobank.com.cn](mailto:zhangjialu@metrobank.com.cn)

陈琦慧 电话 : 021-60934519 邮箱 : [chellychen@metrobank.com.cn](mailto:chellychen@metrobank.com.cn)