

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200227

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. 资金面延续宽松格局，跨月的 7 天也依旧宽松。

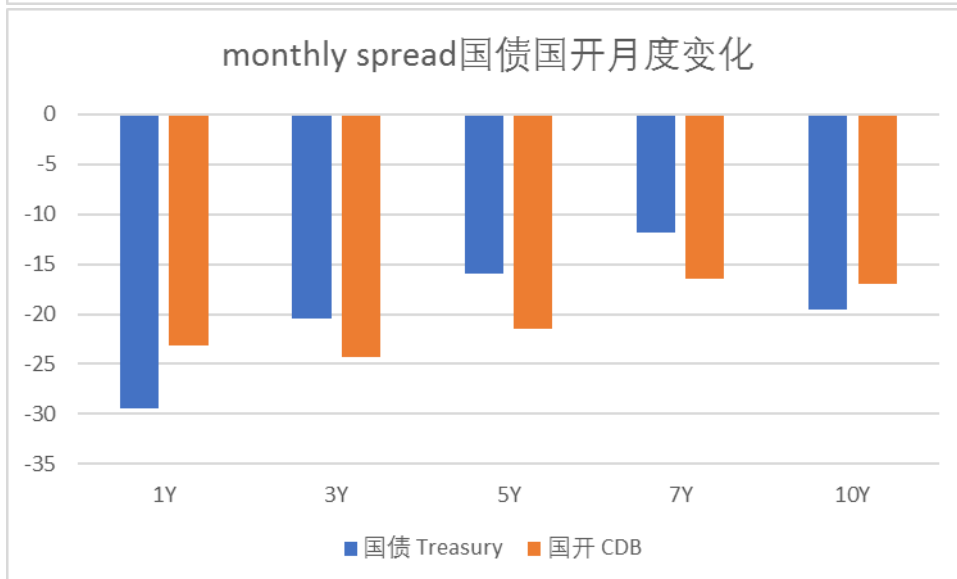
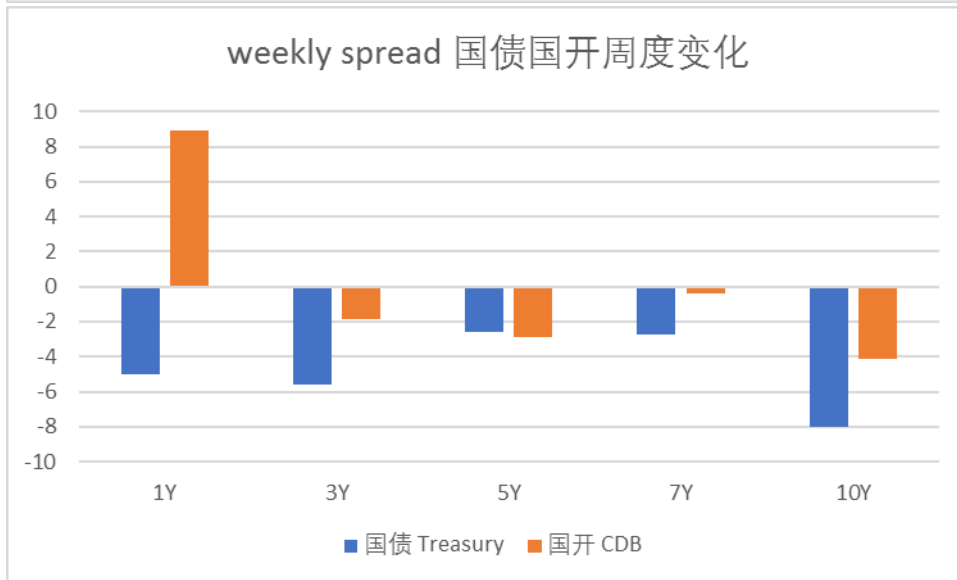
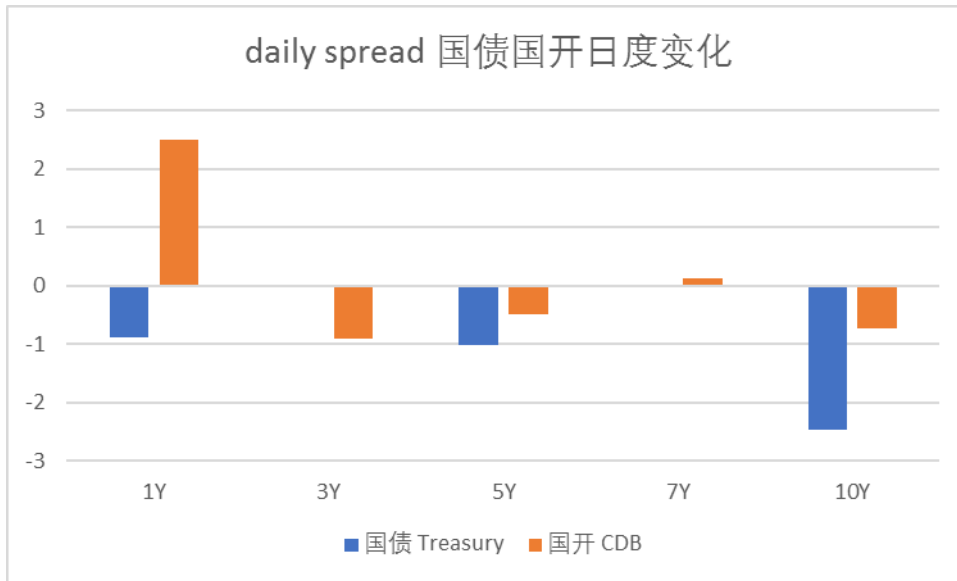
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.48	-11	-13	-90	28385	-3%
7天	2.06	-1	-5	-47	4251	-7%
14天	2.01	1	-8	-76	673	4%
1月	-	-202	-220	-273	11	-46%
3月	2.43	243	-8	-10	18	-49%

Shbor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.50	-10	-13	-95
7天	2.18	-2	-9	-37
14天	2.07	-1	-6	-72
1月	2.31	-1	-6	-52
3月	2.44	-2	-7	-42

数据来源：Wind

债券

1. 国内肺炎疫情有所缓和，大 A 股表现强势。但全球疫情情况有所加剧，美债下行至 1.30%。
2. 昨日收盘前，央行称，对地方法人银行新发放不高于 LPR 加 50bp 的普惠小微企业贷款允许等额申请在贷款资金。此为定向降息。对现券收益率有所提振。全天震荡行情下，10Y 国债 10 国开分别下行 1bp 左右。



数据来源：Wind

汇率

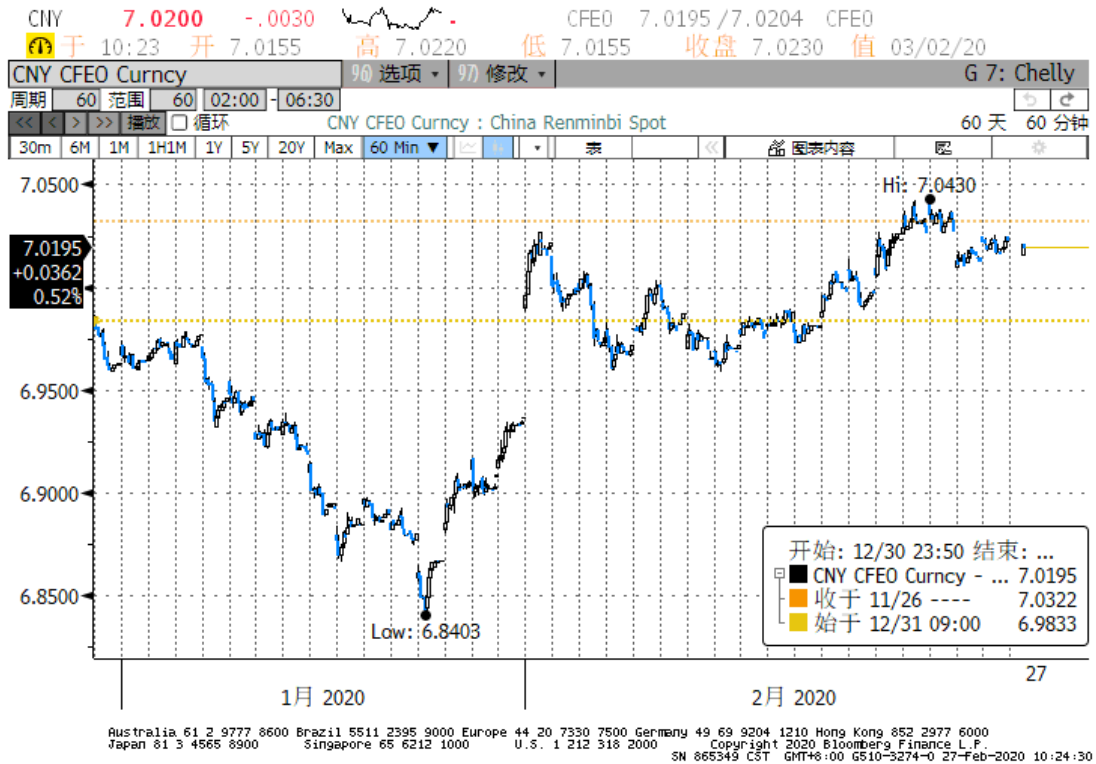
周三人民币兑美元中间价报 7.0126，较上日大幅调升 106 点。境内外人民币周三盘初走贬后，日内保持约百点范围内的横盘整理。16 点前后美元对多数货币下跌，人民币也随之收回日内多数失地。16:30 境内人民币收盘报 7.0170，较上一交易日微幅收跌 8 个点。

昨天彭博以中间价模拟的 CFETS 汇率指数升至 93.16，为今年 1 月 21 日以来新高，中国境内疫情逐渐得到控制，而海外疫情却呈现蔓延之势，支撑人民币兑一篮子货币近日走强，短期来看人民币有望维持这一特质。但预计人民币兑强势美元没有大幅反弹空间，后市随着一二月份的经济数据出炉，人民币大概率兑美元维持弱势。

美元兑人民币 2020 年 02 月 26 日日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/02/26



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

陈琦慧 电话 : 021-60934519 邮箱 : chellychen@metrobank.com.cn