

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200228

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 7 天押信用仅 2.4-2.6%

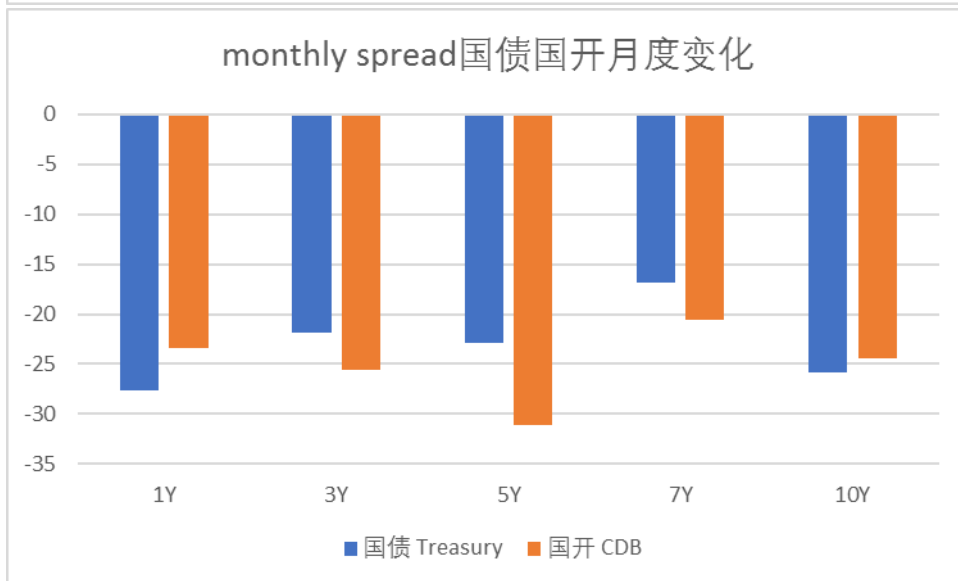
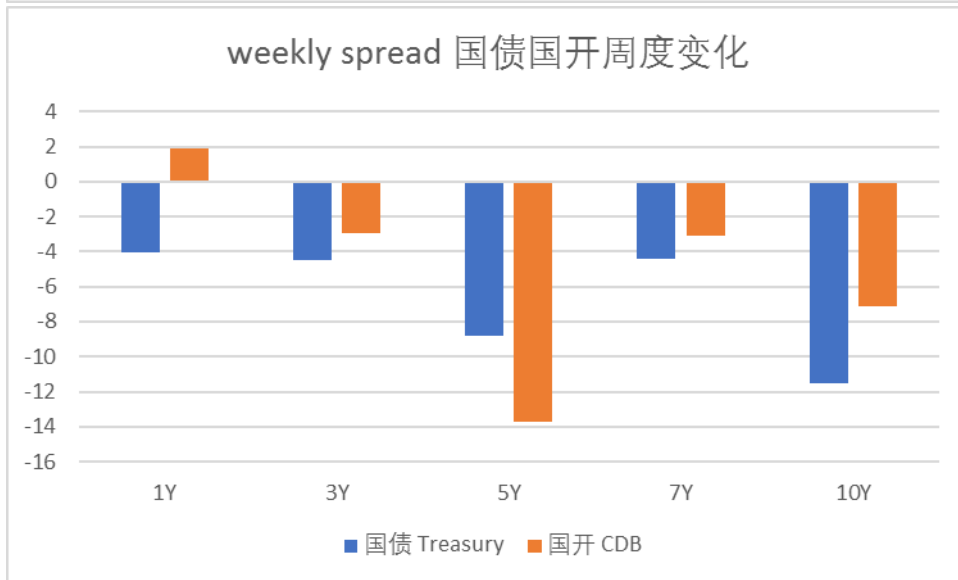
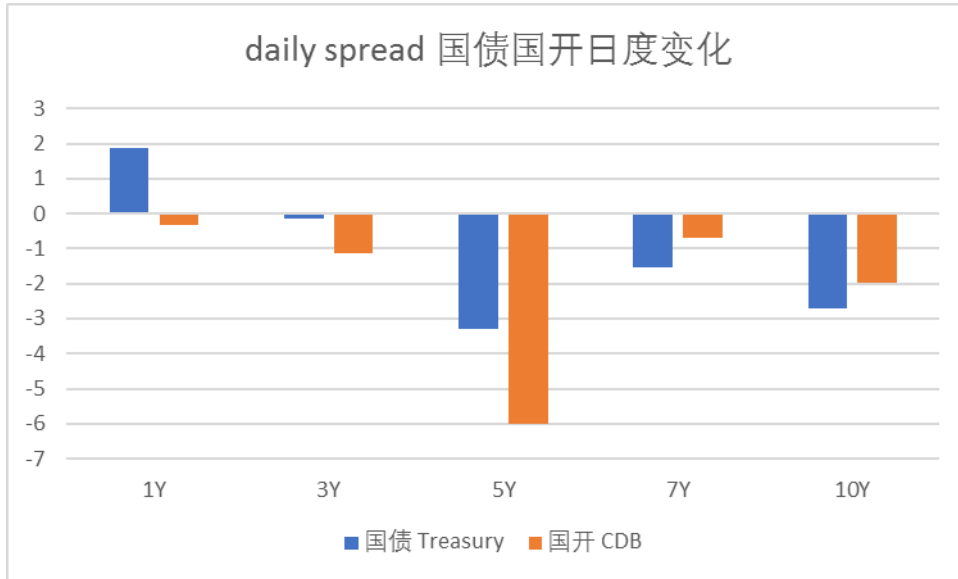
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.32	-15	-6	-105	28915	2%
7天	2.14	8	4	-39	4556	7%
14天	2.04	3	-1	-74	472	-30%
1月	2.08	-0	-19	-65	35	228%
3月	2.44	244	28	-10	19	5%

Shbor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.35	-15	-6	-110
7天	2.19	1	-12	-36
14天	2.09	1	-3	-71
1月	2.30	-0	-6	-52
3月	2.43	-1	-7	-43

数据来源：Wind

债券

1. 十年美债创新低，进一步走至 1.3005%，疫情的国际影响刚开始发酵。国内货币政策暖风不断，央行副行长刘国强表示，对普惠金融服务达标的银行择机定向降准。
2. 我国债市继续反映利多下行。债市昨天下行 1bp，今日开盘亦继续下行 2bp。



数据来源：Wind

汇率

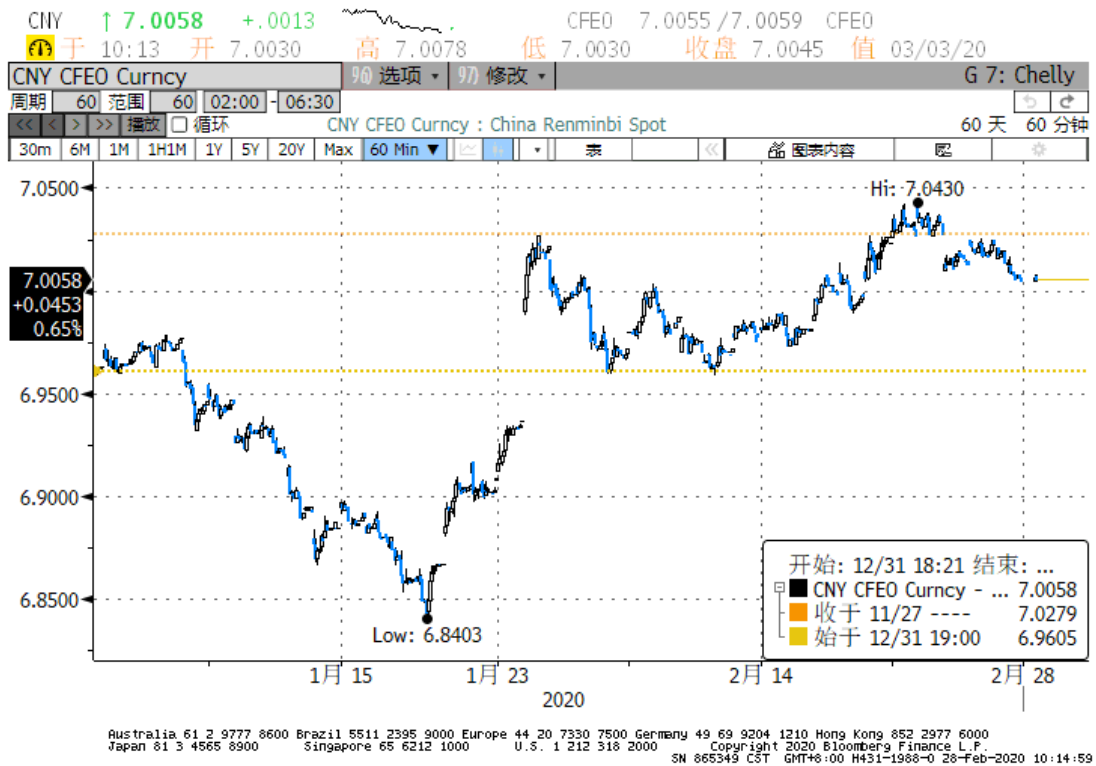
周四人民币兑美元中间价报 7.0215，较上日调降 89 点。由于美元兑多数货币下跌，而人民币日内涨势有限，人民币对一篮子货币出现小幅回软。境内市场中银行自营偏向美元空方，但客盘逢低购汇力道不减，使双边汇率继续保持在 7.02 元附近。16:30 境内人民币收盘报 7.0161，较上一交易日微幅收升 9 个点。

中国下月才会公布大量经济数据为疫情影响提供指引，但眼下海外疫情迅速恶化，包括美国在内疫情有短期内爆发的可能，美联储降息预期升温，施压美指，人民币获得短期提振。预计短线美元结汇自营增加，但后市人民币反弹空间有限。

美元兑人民币 2020 年 02 月 27 日日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/02/27



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