

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200319

货币市场

1. 资金面泛滥，公开市场操作净操作为 0，央行体系流动性总量处于合理充裕水平。
2. 全天货币市场无波澜。

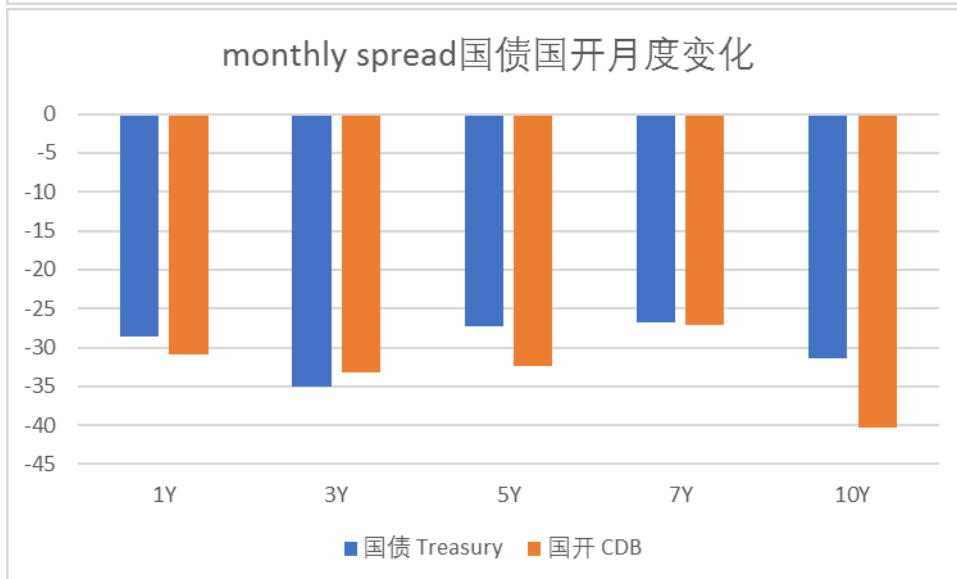
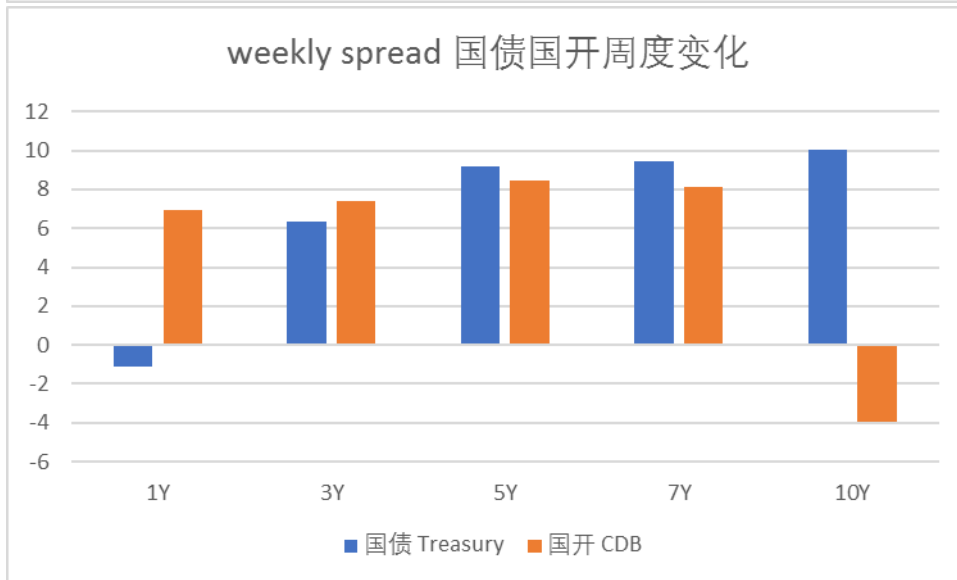
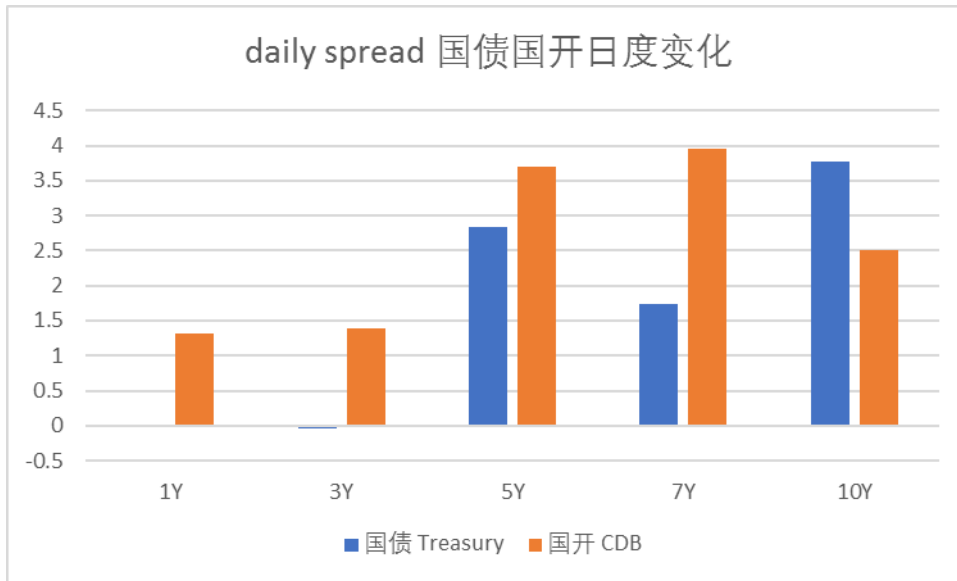
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.07	-15	-93	-130	37635	6%
7天	1.75	-19	-43	-78	4027	-1%
14天	1.76	-8	-20	-102	326	-35%
1月	2.16	21	25	-57	151	-17%
3月	2.10	-4	-7	-43	20	35%

Shbor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.08	-15	-93	-136
7天	1.90	-30	-35	-65
14天	1.85	-12	-13	-95
1月	2.06	-3	-7	-76
3月	2.15	-3	-8	-71

数据来源：Wind

债券

1. 美国再次推猛药救市，每人 1000 美元另外有万亿美元刺激计划，美股下跌势头暂时被遏制，但美债继续上行。国内债市受美债影响，昨日高开。但全天资金面泛滥，日内下行。尾盘重新震荡回调。
2. 今日行情基本在当前位置震荡。基本面、政策、资金面、外围因素基本都已 price in，市场窄幅波动。



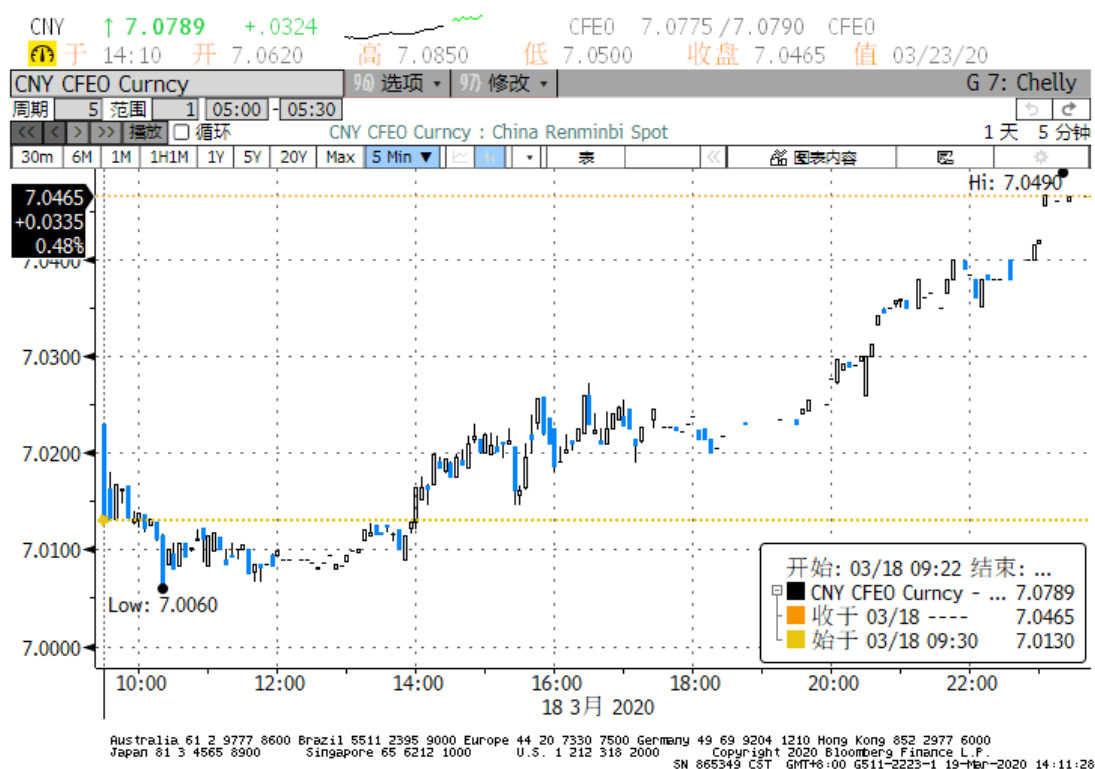
数据来源：Wind

汇率

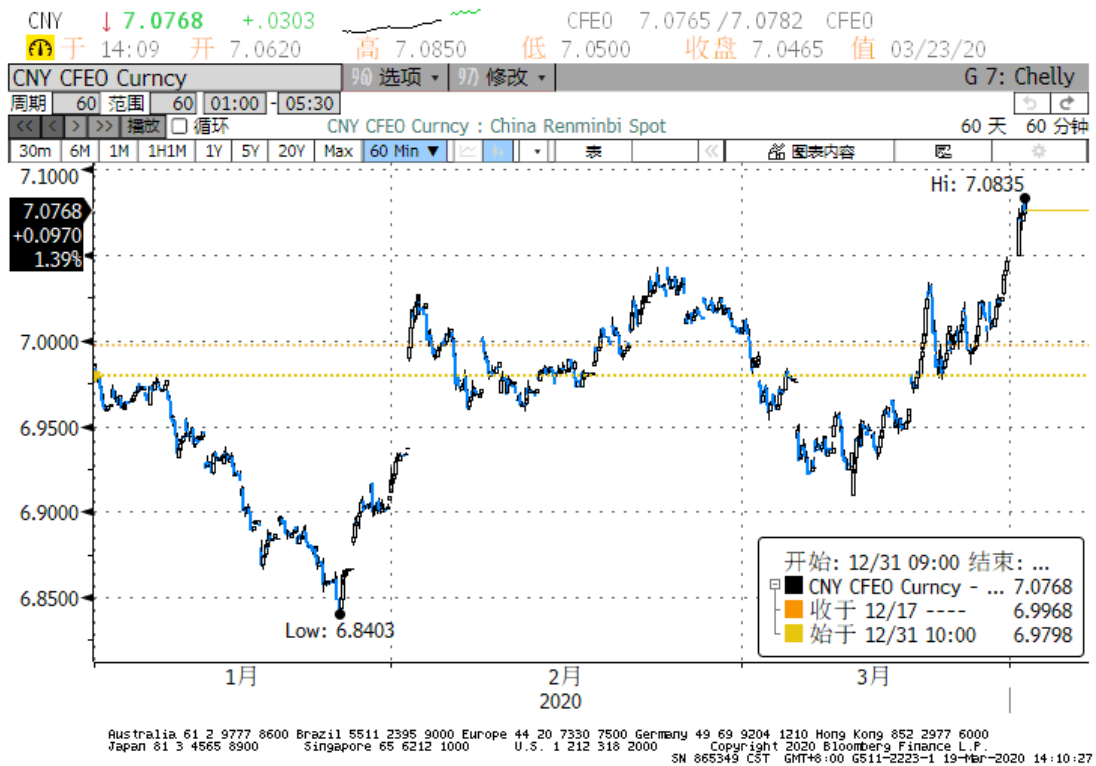
周三人民币兑美元中间价报 7.0328，较上日大幅调降 234 点。境内外人民币于下午随新兴市场货币扩大对美元跌势，其中离岸人民币走势相对于在岸更为疲弱，境内外即期点差重新扩大到 200 点以上。16:30 境内人民币收盘报 7.0260，较上一交易日大幅收跌 164 点。

随着美元流动性紧缺，所有资产遭到抛售，美指走升至三年高位，离岸人民币夜盘昨天夜盘走跌至 7.07 段位。预计今日在岸开盘波动区间上移，但兑一篮子货币仍将持稳。

美元兑人民币 2020 年 03 月 18 日日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/03/18



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