

# 首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200323

## 货币市场

1. 资金面继续泛滥式宽松，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。全天货币市场无波澜，隔夜加权利率进一步降至 0.86%。
2. 境外美元市场则出现宽松趋势。

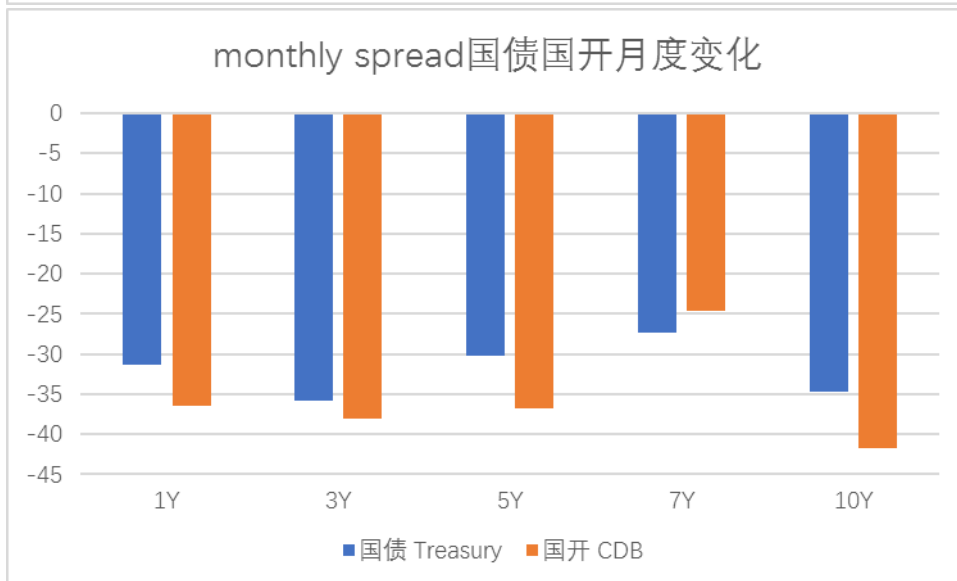
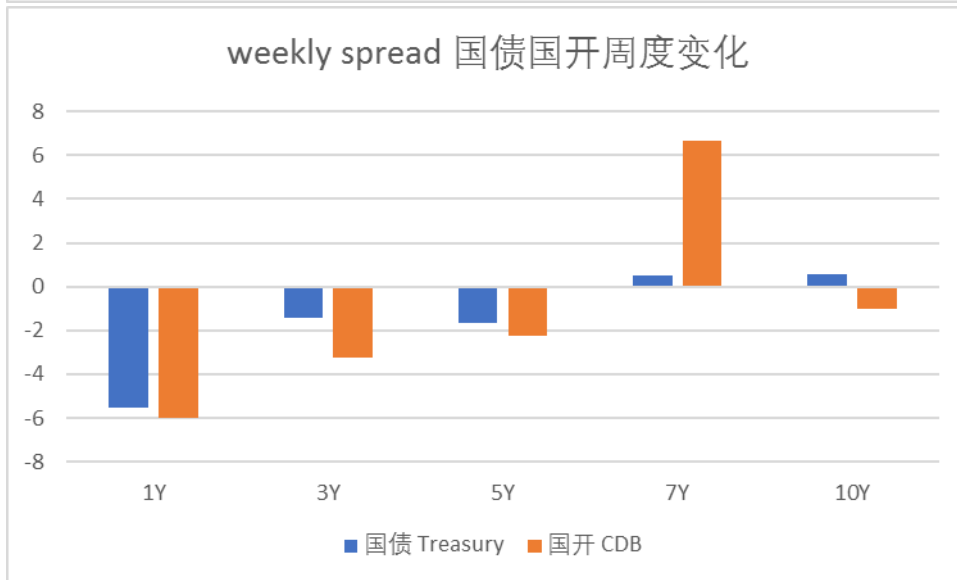
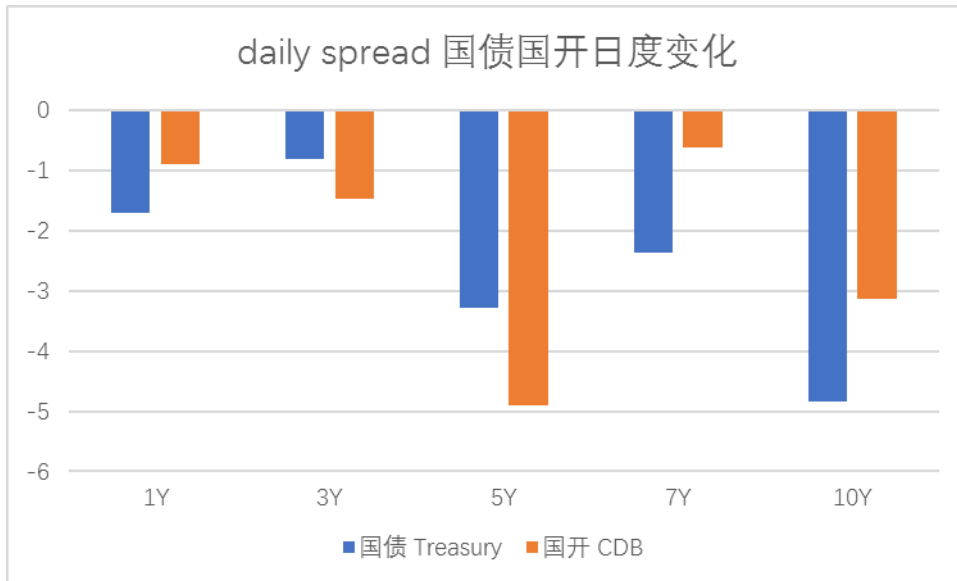
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	0.79	-5	-62	-158	39831	3%
7天	1.57	-6	-50	-97	2399	-17%
14天	1.60	-9	-28	-118	1407	1%
1月	2.09	9	10	-64	94	98%
3月	2.20	7	5	-33	22	-20%

Shbor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	0.80	-5	-62	-165
7天	1.95	5	-31	-60
14天	1.77	4	-22	-102
1月	1.99	-1	-13	-83
3月	2.09	-2	-12	-77

数据来源：Wind

## 债券

1. 随着美联储释放更多资金，打通银行和非银之间断层的一系列操作，美元指数有所下行，表明境外抛盘有所缓解。国内债市尾盘横扫阴霾，收益率大幅下行。
2. 流动性危机引发信用危机，美联储也注入资金购买信用等级差的企业债来维持市场。



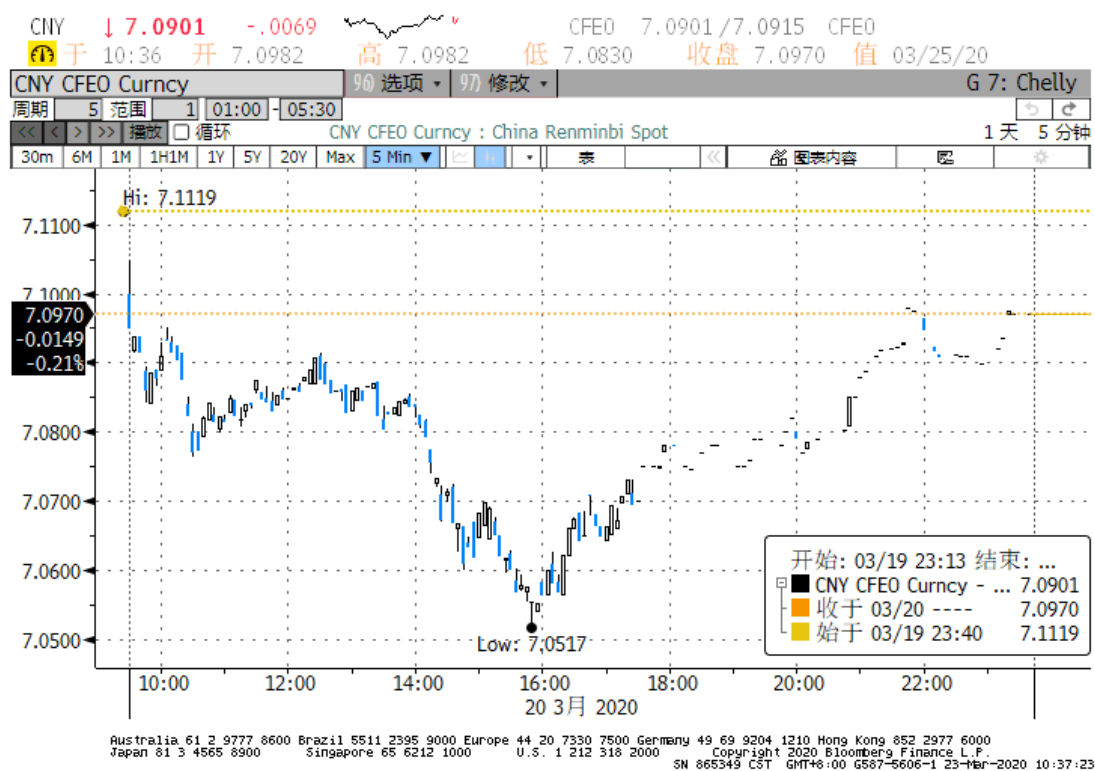
数据来源：Wind

## 汇率

周五人民币兑美元中间价报 7.1052，较上日大幅调降 530 点。各国连续推出对抗疫情的刺激措施，风险偏好有所回暖，美元对多数货币出现显著回落，境内外人民币即期汇率大幅反弹。16:30 境内人民币收盘报 7.0661，较上一交易日大幅收升 249 点。

美元流动性或边际改善，但疫情之下股指难言触底，避险性需求下人民币预计短期兑美元承压，但对一篮子货币仍有望保持稳定或偏强。

美元兑人民币 2020 年 03 月 20 日日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/03/20



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)