

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200325

货币市场

1. 资金面略有收敛，当天公开市场净操作为 0。目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平。

资金面受金融债缴款、缴税、加权利率低等因素影响，隔夜融出有所减少。但 7 天以上共计充足。

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	0.81	-2	-26	-77	42320	1%
7天	1.14	-44	-62	-93	2272	-23%
14天	1.53	-5	-23	-47	2526	34%
1月	2.09	27	13	6	101	-26%
3月	2.08	-1	-7	208	10	-6%

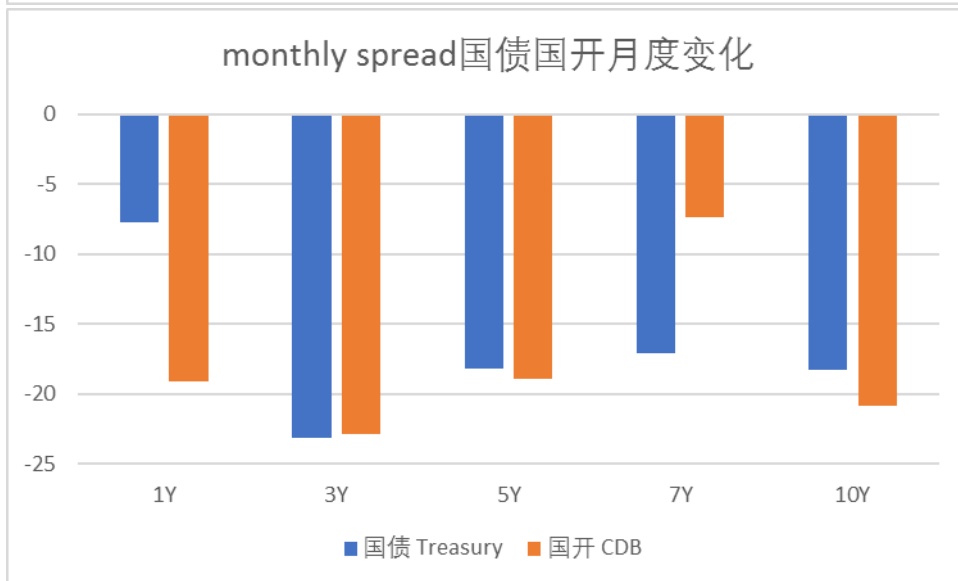
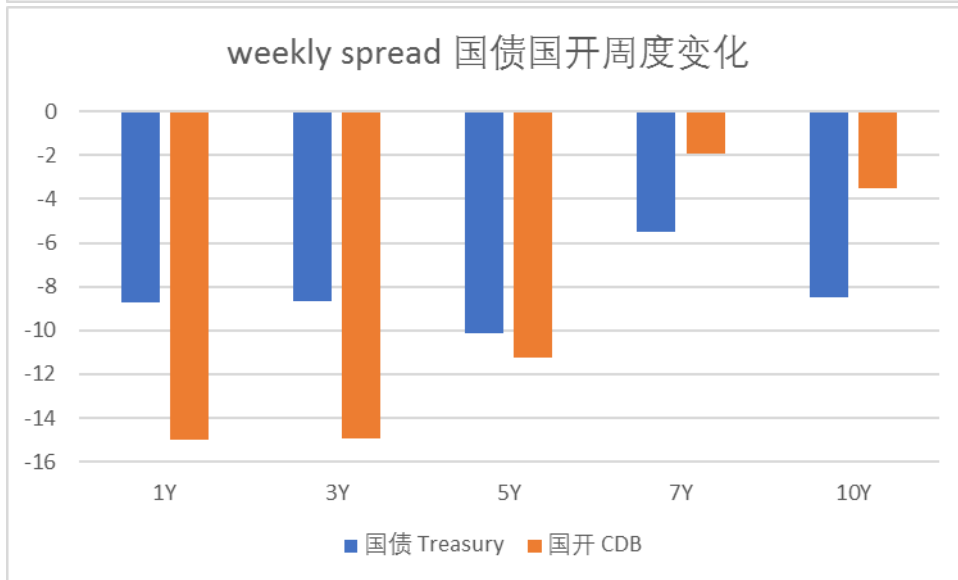
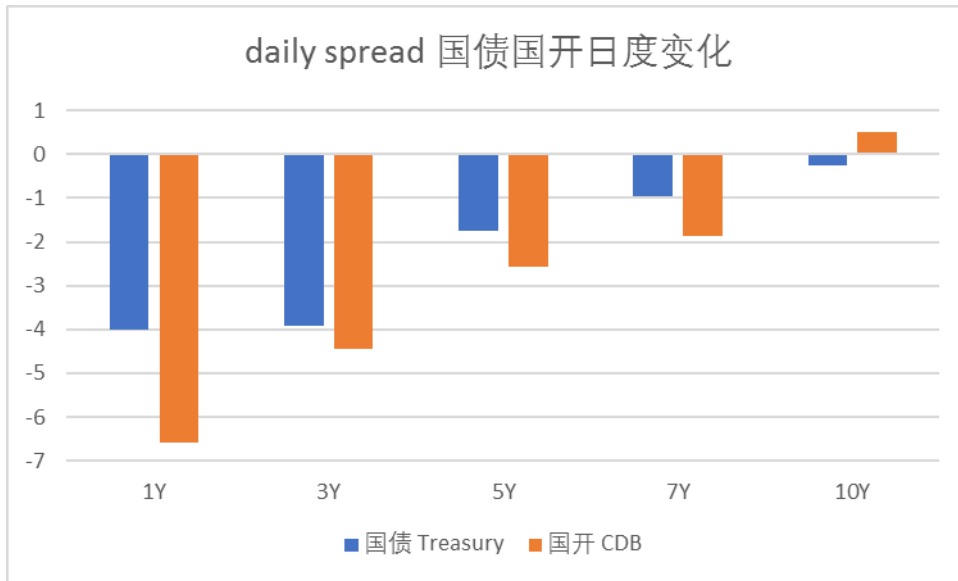
Shbor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	0.81	-3	-27	-79
7天	1.69	-11	-20	-51
14天	1.67	-6	-18	-42
1月	1.94	-2	-13	-38
3月	2.06	-2	-9	-40

数据来源：Wind

债券

1. 美联储放出无限量 QE 刺激市场，美股夜盘终于止跌回涨，流动性缓和后，股、债、黄金各自有所回归。

2. 美债盘前波动不大，国内债券受影响较小，早盘低开后止盈盘厚重。日内 IRS 下行 10bp，带动现券日内下行 2bp。国债期货收盘后，现券反弹，全天收盘上行 1bp。市场资金目前进入迷茫期。短期国债 10Y 2.65 为中枢位置，可择机参与。



数据来源：Wind

汇率

周二人民币兑美元中间价报 7.0999，较上日调降 56 点。美联储宣布不限量购债等举措提振风险资产，亚洲股汇市场齐涨，人民币也于日内上涨，不过前一段时间人民币兑美元跌幅相对较小，反弹空间不大，因此昨日涨幅在亚洲货币中靠后。16:30 境内人民币收盘报 7.0769，较上一交易日大幅收升 418 点。

昨夜美股大幅反弹，风险情绪升温，离岸人民币跟随新兴市场货币反弹。预计今日在岸人民币也随着反弹。

美元兑人民币 2020 年 03 月 24 日日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/03/24



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