

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200812

货币市场

1. 昨日公开市场操作净投放 500 亿，
2. 但资金面感受上偏紧，隔夜利率+30bp。午后融出渐多，逐步宽松，尾盘减点。

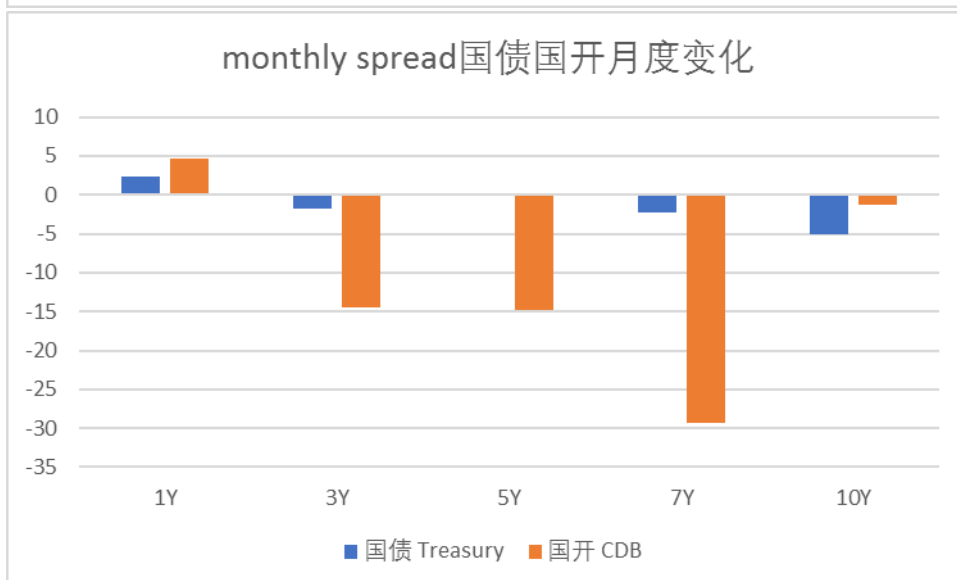
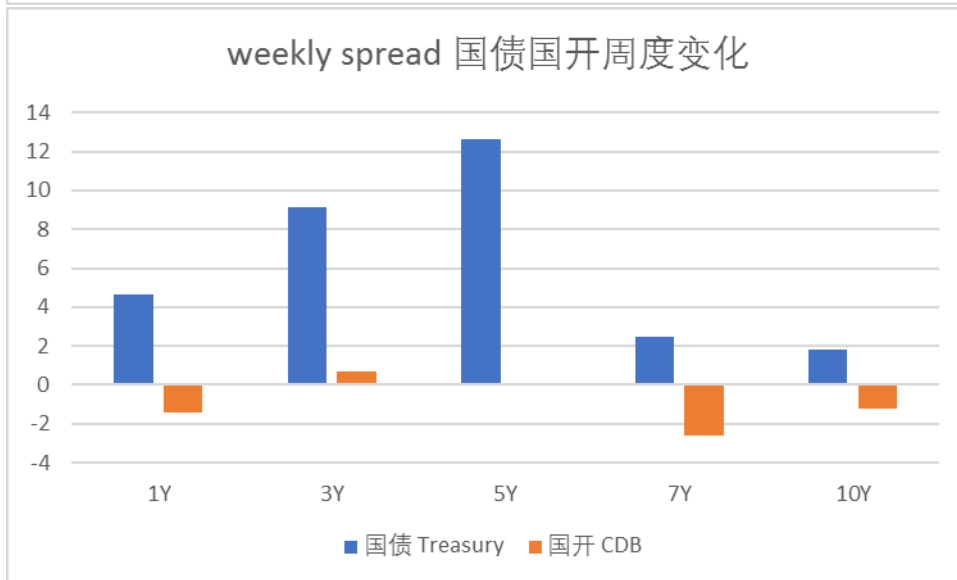
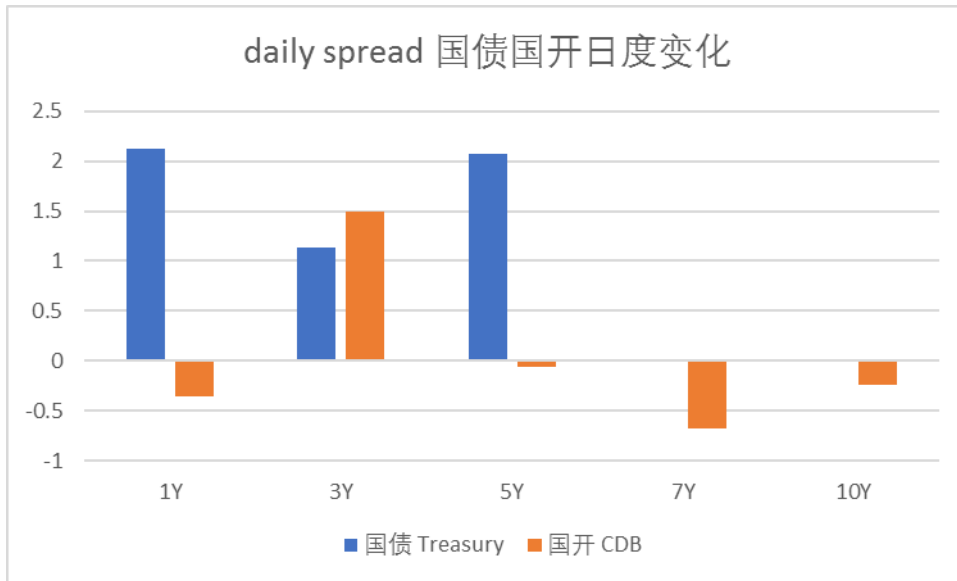
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	2.18	5	28	52	33321	-2%
7天	2.24	5	13	14	4377	18%
14天	2.25	11	25	18	735	30%
1月	2.30	23	22	22	165	-42%
3月	2.75	49	73	55	13	-57%

Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	2.20	7	28	53
7天	2.25	5	11	10
14天	2.20	10	15	10
1月	2.30	0	1	22
3月	2.60	-0	0	41
6月	2.76	0	2	47

数据来源：Wind

债券

1. 现券先上后下，早盘资金面感受偏紧，股市震荡上行，央行购买国债的传言得到解释。午后，社融数据低于预期，7月新增人民币信贷不足万亿。尾盘下行回到开盘位置。全天中短端上行 2bp 左右，长端 10Y 基本持平。
2. 近期震荡格局，10bp 以内机会不大，风险也不大。

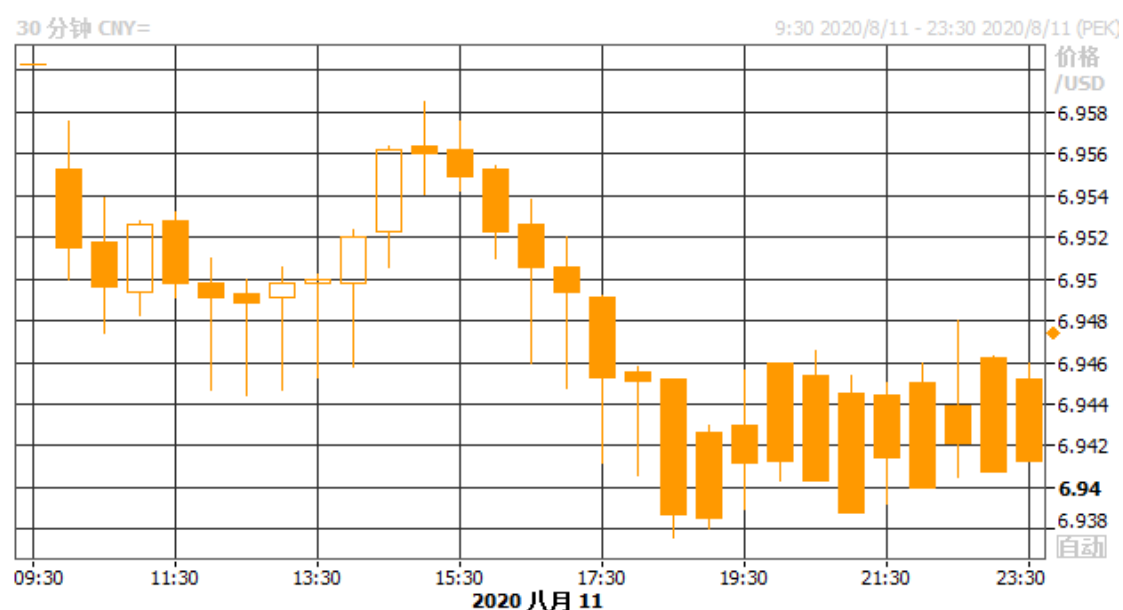


数据来源：Wind

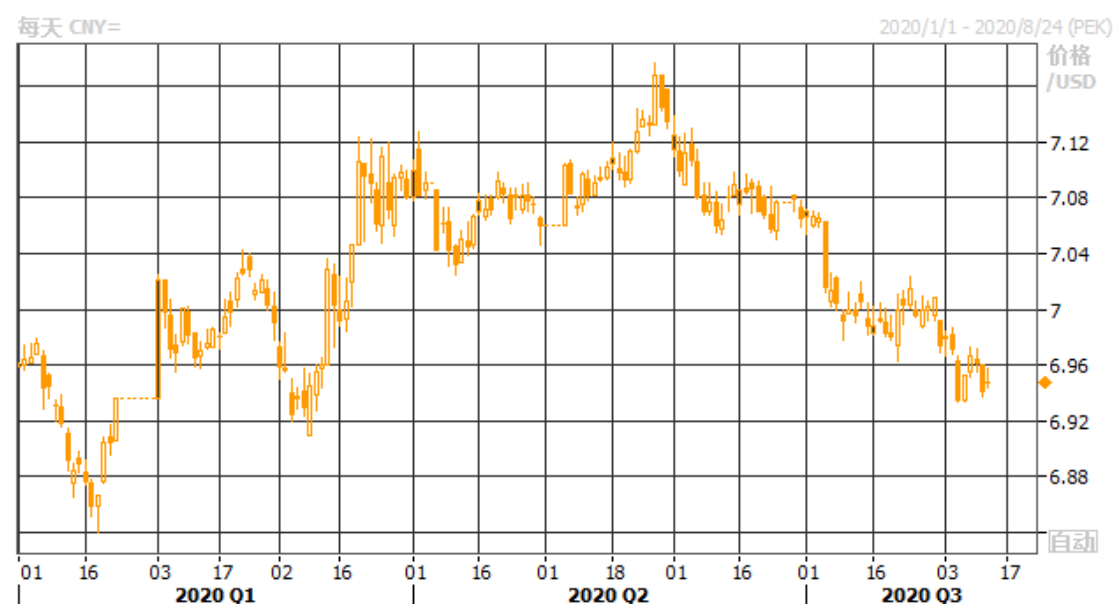
汇率

人民币兑美元即期周二放量收升至 6.9519，中间价则小跌至近一周新低 6.9711。美指跌势暂止人民币也遇阻；但日内离岸人民币流动性收紧推升 CNH 汇价，并带动在岸汇价反弹，中国经济基本面表明人民币没有大幅贬值的基础，如果外部环境改善，人民币仍有望升值；但本周中美贸易协议评估一旦超预期恶劣，人民币可能短期急贬，周末前市场多保持谨慎，部分自营头寸离场。中美关系紧张局面难改，人民币短期料维持宽幅震荡。

美元兑人民币 2020 年 08 月 11 日日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/08/11



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 :Reuters

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

赵思恒 电话：021-61910703 邮箱：iriszhao@betrobank.com.cn