

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200813

货币市场

1.资金面偏紧，资金利率始终维持在较高水平。午后北京部分机构因为暴雨预警，提前收盘。略有紧张。尾盘转松。

2.公开市场操作净投放 1400 亿。银行体系流动性合理充裕。

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	2.15	-3	48	11	34705	4%
7天	2.25	0	23	9	4072	-7%
14天	2.27	2	24	18	608	-17%
1月	2.36	14	21	25	152	-8%

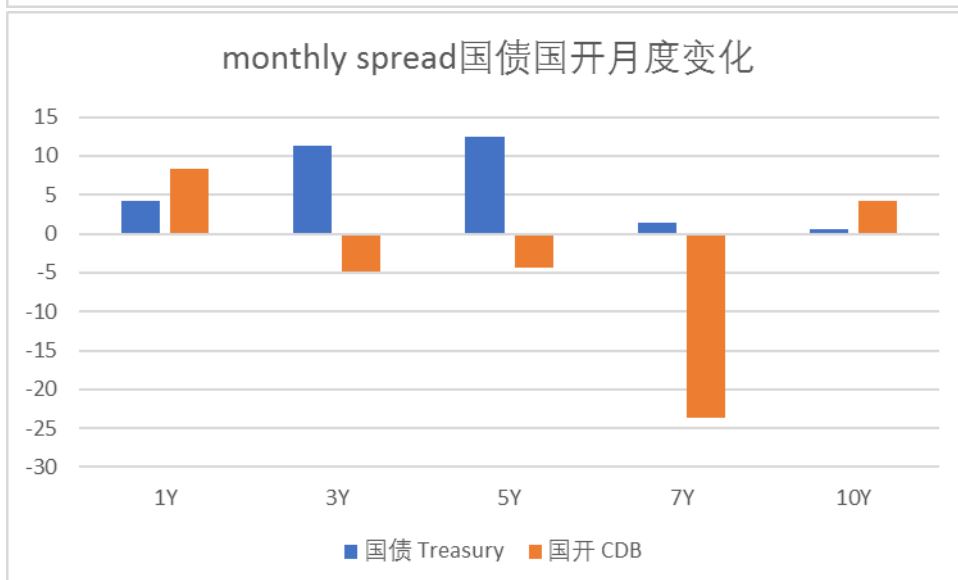
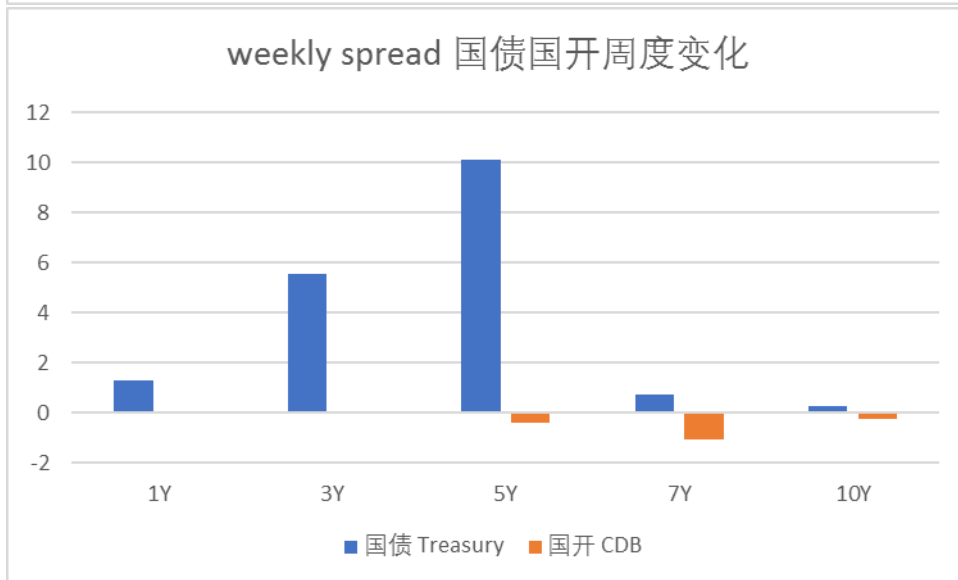
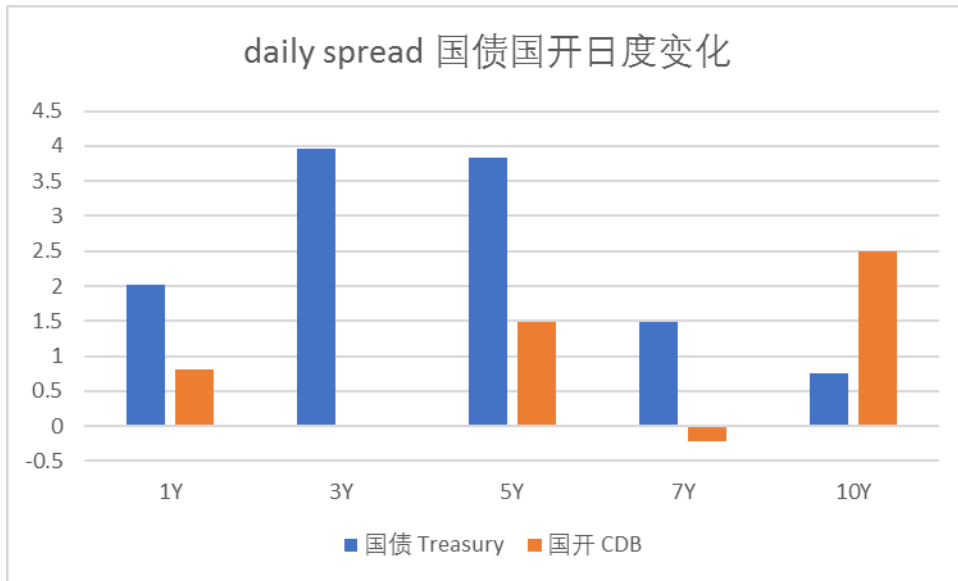
Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	2.15	-5	46	13
7天	2.25	-0	18	10
14天	2.27	7	24	16
1月	2.30	0	2	20
3月	2.60	0	0	36
6月	2.76	1	2	43

数据来源：Wind

债券

1.昨日现券窄幅震荡。3年5年国债继续上行。其他品种波动不大，10Y 国债上行 1bp 以内，10Y 国开 2.5bp。尾盘之间有一波拉升，传原因为下周国债一级缩量发行 620 亿。但情绪仍旧不稳，收盘再度回调。

2.消息面空窗期，债券维持区间震荡。

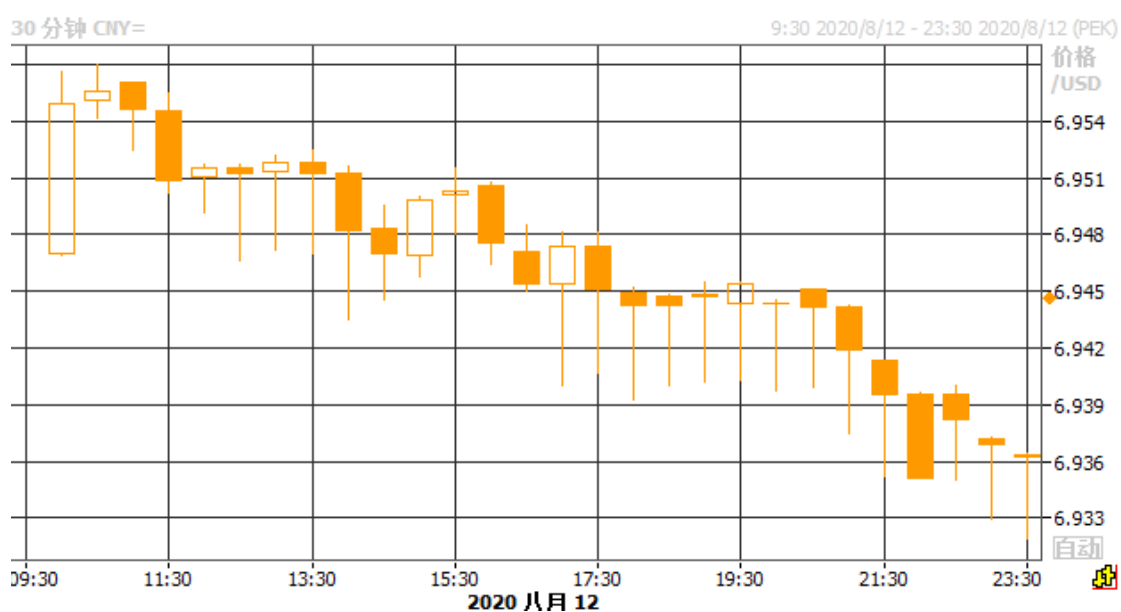


数据来源：Wind

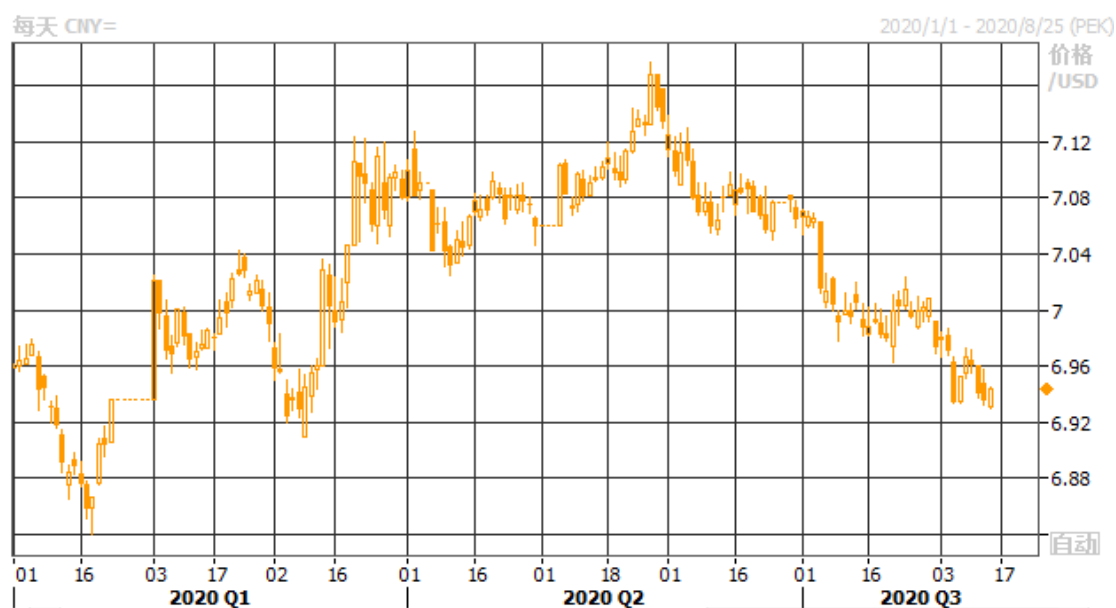
汇率

人民币兑美元即期周三放量收升至近一周新高 6.9458, 中间价亦创近一周高位 6.9597 ; 日内美指冲高回落, 人民币表现相对坚挺, 午后扩大反弹, 不过中美近期即将就贸易协议进行评估, 短期市场不确定性仍大, 人民币续升空间受限。从美国官员的表态看, 中美贸易协议大概率平稳推进, 不过关键风险释放前, 部分头寸仍采取对冲操作, 短期限期权波动率稳步上行, 买需也较旺。本周人民币应该难有大的波动, 主要看中美贸易评估结果, 前市场对于中美评估会议的预期偏乐观一点。如果有利好的话, 人民币有机会升至 6.9 附近

美元兑人民币 2020 年 08 月 12 日日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/08/12



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