

# 首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200817

## 货币市场

1. 上周公开市场操作净投放 4900 亿。周一 OMO 逆回购 7 天续作 500 亿，MLF 超量续作 7000 亿。流动性合理充裕。
2. 资金面感受近期都是早盘紧平衡，午后尾盘放松。量够，价格平稳。

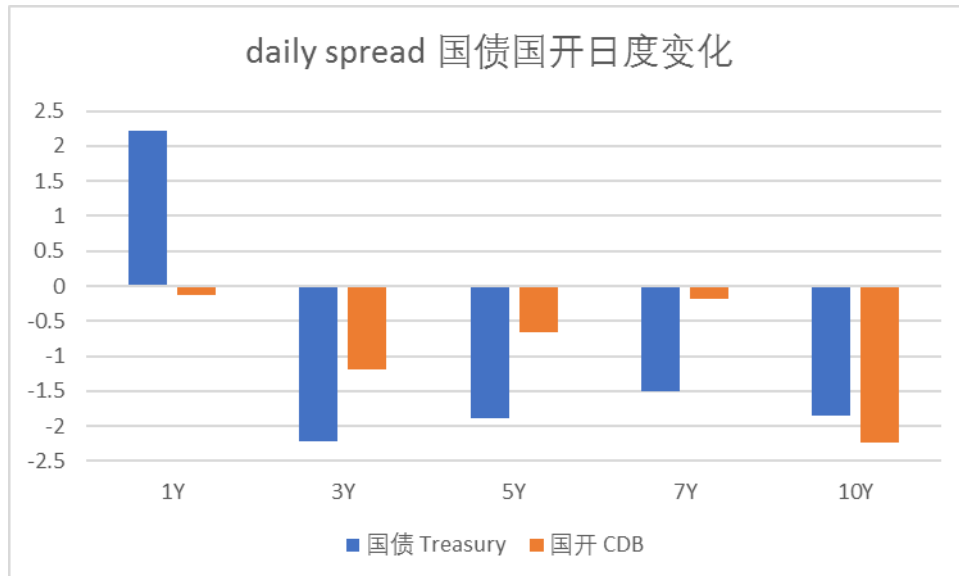
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	2.17	0	11	-14	34270	1%
7天	2.21	-3	1	-3	3873	3%
14天	2.30	1	25	-14	325	-47%
1月	2.39	2	38	-11	100	-21%

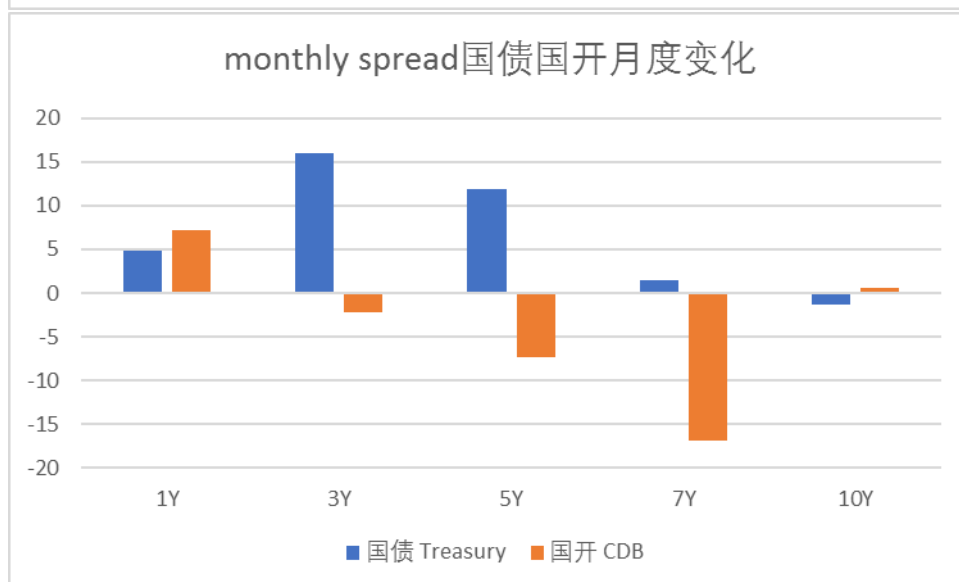
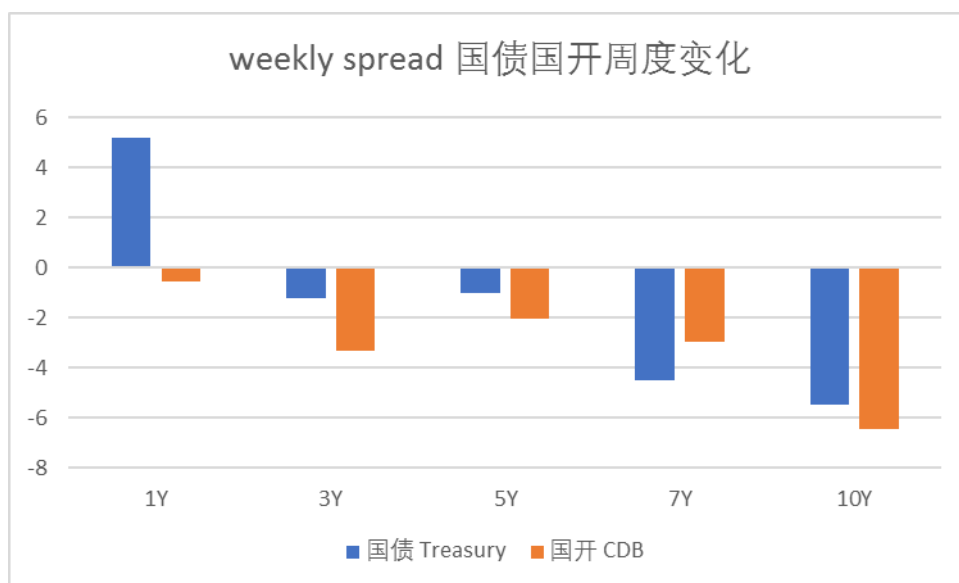
Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	2.18	1	12	-15
7天	2.22	-2	2	-0
14天	2.31	2	26	-12
1月	2.31	1	2	11
3月	2.60	-	-0	25
6月	2.78	1	2	34

数据来源：Wind

## 债券

1. 上周五公布的消费和工业数据低于预期，市场打消了此前对通胀上行的预期。加上资金面的持续投放呵护。整体情绪偏好。各期限收益率下行 2bp 左右。
2. 周一收益率继续下行，国债期货近期移仓，走势偏震荡。做多过程需要耐心和谨慎。



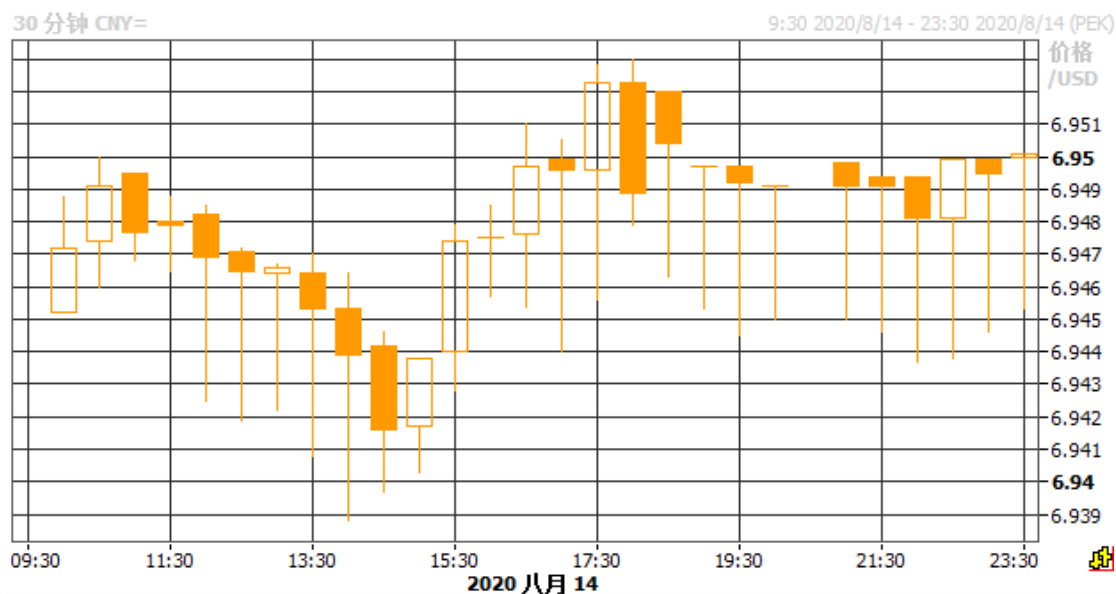


数据来源：Wind

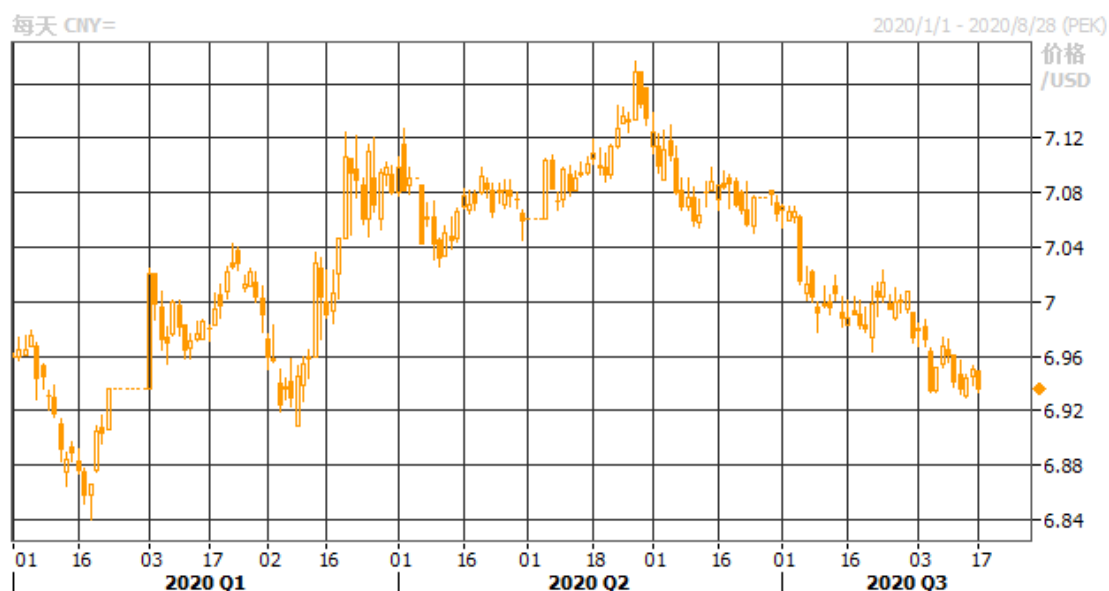
## 汇率

人民币兑美元即期周五收盘缩量小跌 6.9498，日内有效波幅仍不大，中间价则小升至逾五个月新高 6.9405。中美贸易协议评估推迟新的评估日期尚未确定，市场观望情绪较浓，但总体市场比较看好人民币这周或迎来小升行情，但也看后续美元的表现；市场仍预期美国两党就刺激计划能达成协议，这有利于美元短期企稳，不过中期美元仍存较大的调整空间，对人民币而言，中期仍可能受美指影响而反弹。

美元兑人民币 2020 年 08 月 14 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/08/14



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](mailto:zhangjialu@metrobank.com.cn)

陈琦慧 电话：021-60934519 邮箱：[chellychen@metrobank.com.cn](mailto:chellychen@metrobank.com.cn)

赵思恒 电话：021-61910703 邮箱：[iriszhao@betrobank.com.cn](mailto:iriszhao@betrobank.com.cn)