

# 首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200818

## 货币市场

1. 周二早盘，央行继续开展 1000 亿元 7 天期逆回购操作，净投放 500 亿元。
2. 存单和资金利率维持在较高位置，货币政策回归至常态。市场感受紧平衡。

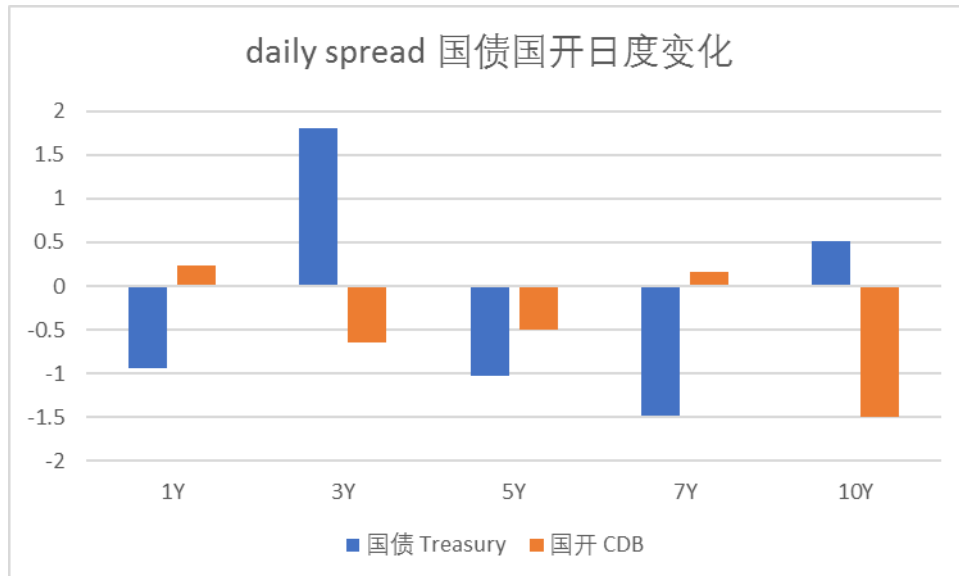
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	2.11	-6	-3	17	35788	4%
7天	2.21	-0	1	6	4319	12%
14天	2.21	-9	8	-7	214	-34%
1月	2.36	-2	28	-8	126	26%

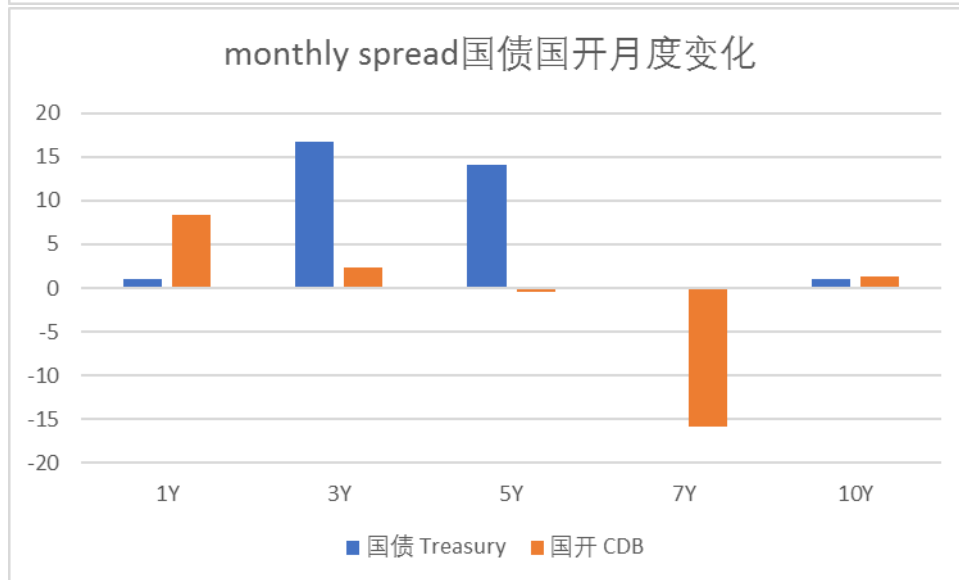
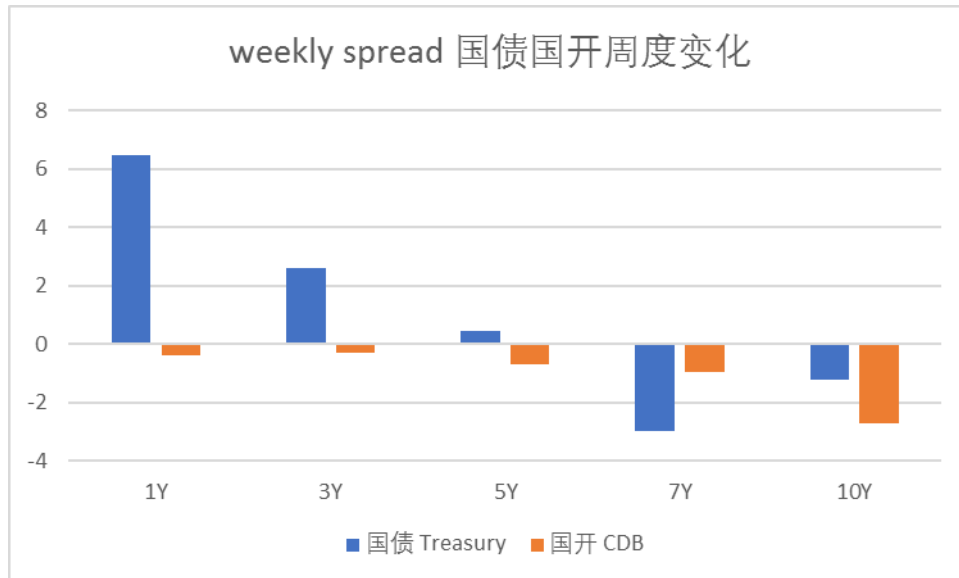
Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	2.13	-5	-0	17
7天	2.21	-1	1	3
14天	2.28	-3	18	-3
1月	2.31	-0	1	9
3月	2.60	0	0	20
6月	2.78	0	2	29

数据来源：Wind

## 债券

1. 江海证券称：目前市场依然面临多空因素交织，利多主要表现在基本面复苏斜率的放缓、中美摩擦的持续和央行对资金面的呵护，利空则主要体现在高频数据大多仍在改善、股市大涨带动风险偏好回升和资金利率依然维持在高位。市场仍缺乏触发利率趋势性变化的明确因素，利率区间震荡的格局短期内暂时难以打破。



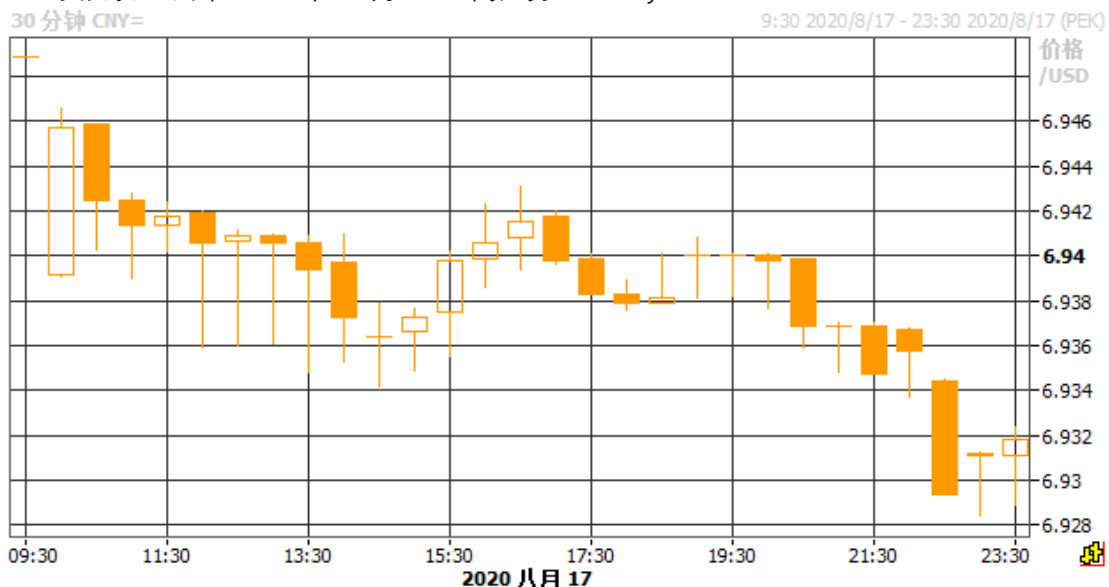


数据来源：Wind

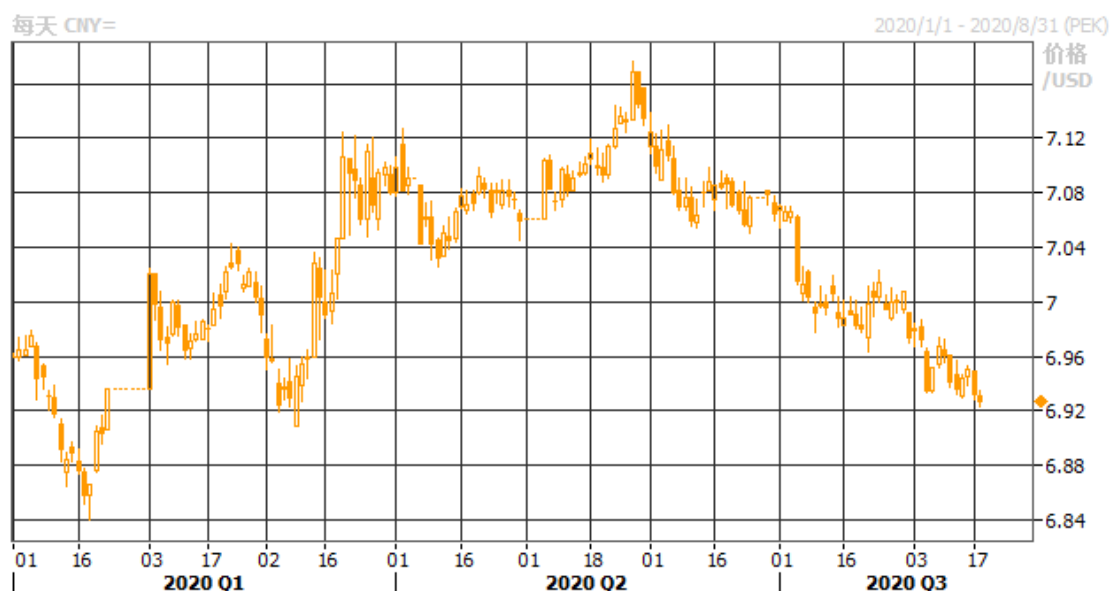
## 汇率

人民币兑美元即期周一收盘升至逾五个月高点 6.9417，中间价创逾五个月新高 6.9362。中美贸易协议评估暂时推迟，市场风险偏好有所回升，今日北向资金加速流入境内股市，带动人民币小升；但中美关系面临的不确定性仍较大，这会持续制约人民币表现。中美第一阶段经贸协议未出现明显干扰因素，中性评估下应该较为顺利，且待风险释放；美国迟迟未能就新一轮刺激计划达成一致，但欧洲亦面临疫情反复冲击，美指未见得会持续走弱，人民币或续追随美指波动。

### 美元兑人民币 2020 年 08 月 17 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/08/17



### 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)