

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200820

货币市场

1. 周三公开市场开展 1500 亿逆回购操作，净投放 100 亿。
2. 全天资金面紧张，早盘隔夜+30bp 左右。午后稍好，尾盘宽松。

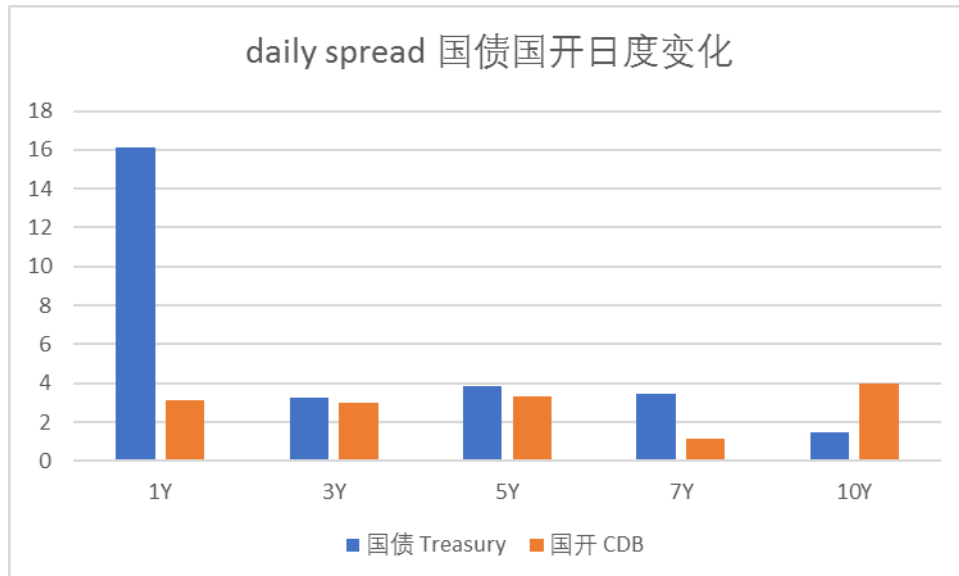
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	2.15	4	0	81	35943	-3%
7天	2.21	2	-4	24	3979	2%
14天	2.27	3	0	12	1056	33%
1月	2.39	6	2	6	75	-35%

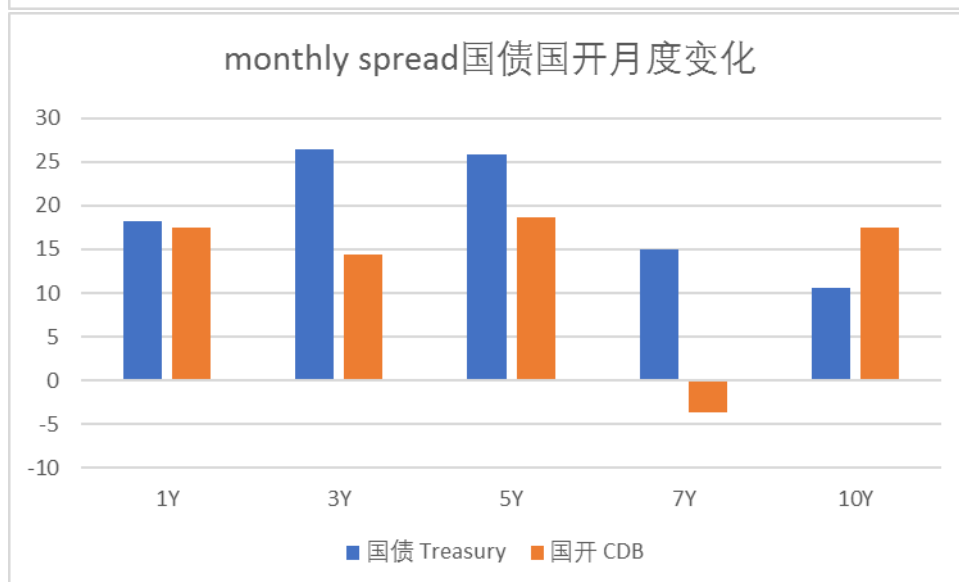
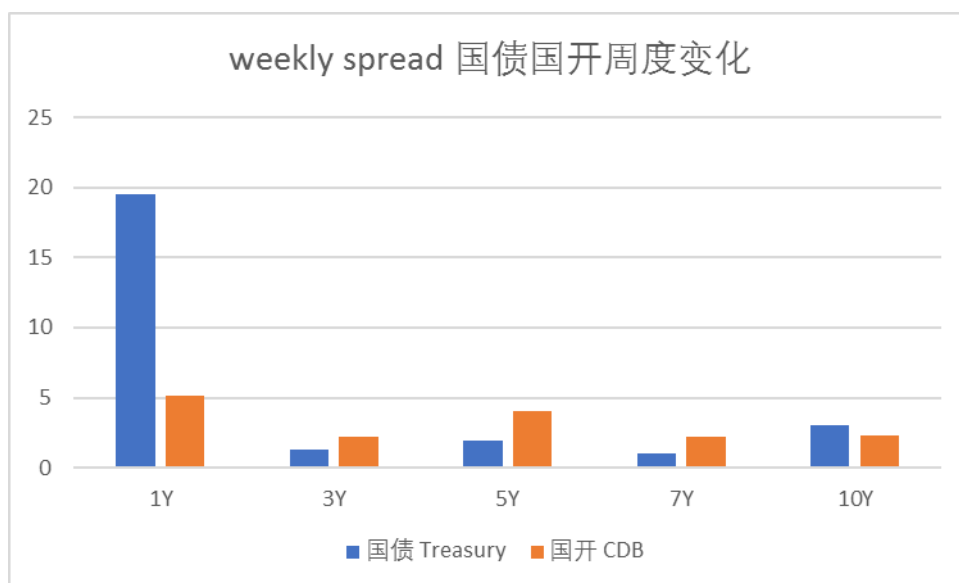
Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	2.15	3	-0	81
7天	2.20	1	-4	20
14天	2.25	2	-2	6
1月	2.31	0	1	8
3月	2.60	-	-0	10
6月	2.80	1	3	17

数据来源：Wind

债券

1. 现券依旧有所阴跌，没有重大消息面因素。国开 10Y 上行 4bp，国债 10Y 上行近 2bp。利率逼近前期高点。
2. 债市存在一定修复空间，区间震荡行情未改。全球流动性预期拐点将至，但基本面因素并未完全走完。



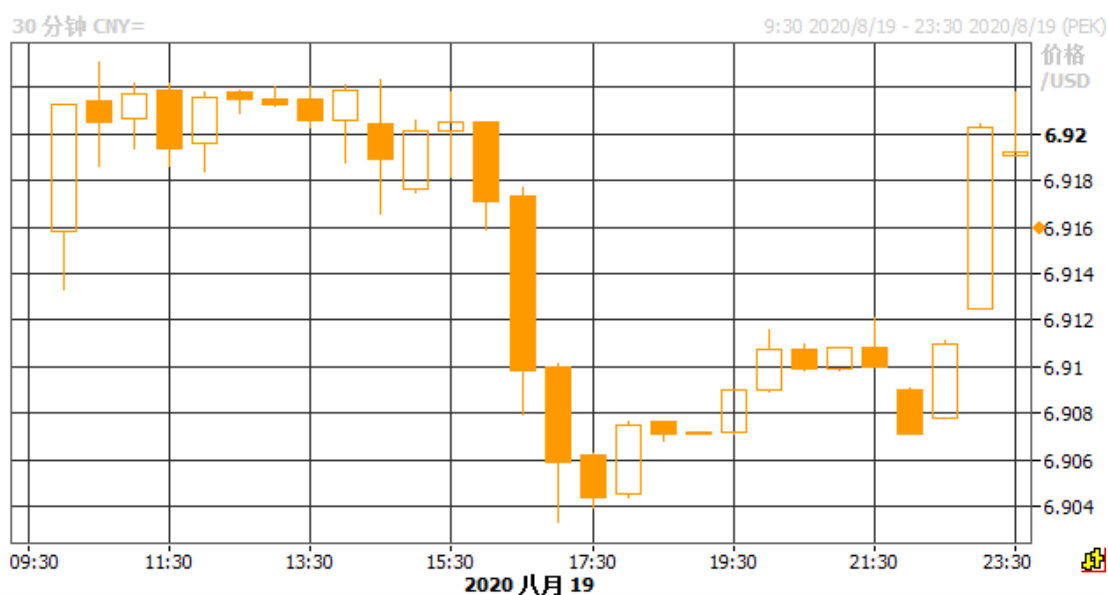


数据来源：Wind

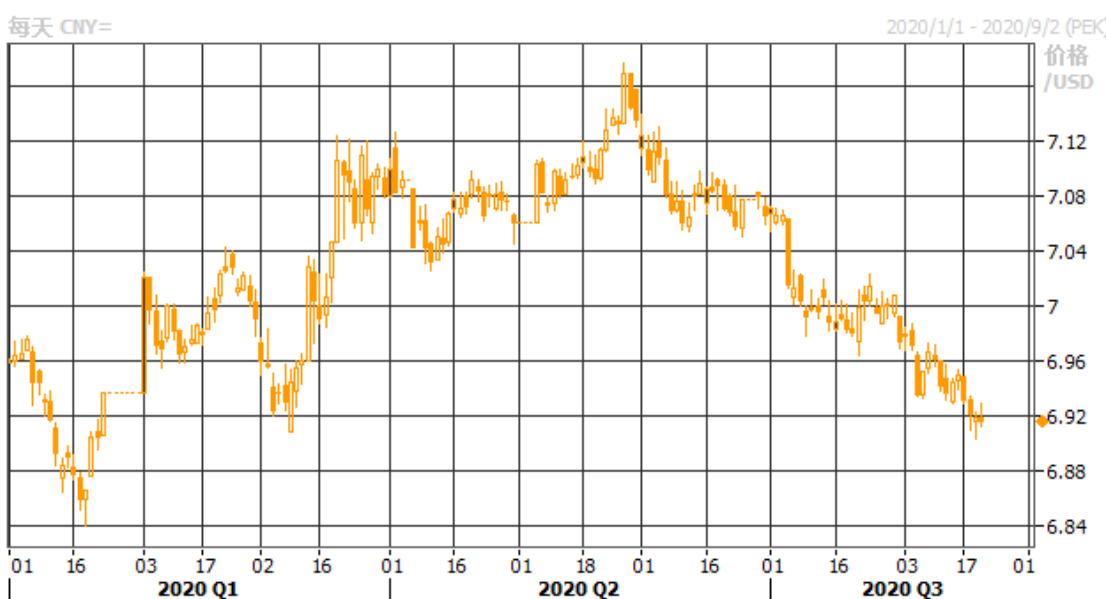
汇率

人民币兑美元即期周三收盘劲升逾 150 点至 6.9103, 与中间价均创近七个月新高 6.9168。美国经济复苏及新财政刺激方案难以落地, 市场持续看淡美元前景, 尾盘人民币一度快速走升, 离岸率先收复 6.9 元关口; 短期在岸汇价也有机会测试 6.9。短期美元疲软和中美局势继续牵制汇市, 后续如果美元阶段性反弹, 人民币资产得益于相对较高的收益率, 汇价相应的调整空间也会比较有限; 市场关注美联储即将公布的会议纪要, 以寻找 9 月前瞻性指引的暗示。

美元兑人民币 2020 年 08 月 19 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/08/19



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