

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200825

货币市场

1. 昨日公开市场操作净投放 1100 亿，央行投放 14 天资金 600 亿，7 天资金 1000 亿，到期 500 亿。资金面早盘紧张，临近中午开始宽松。
2. 日内隔夜利率上行，午后减点频出。

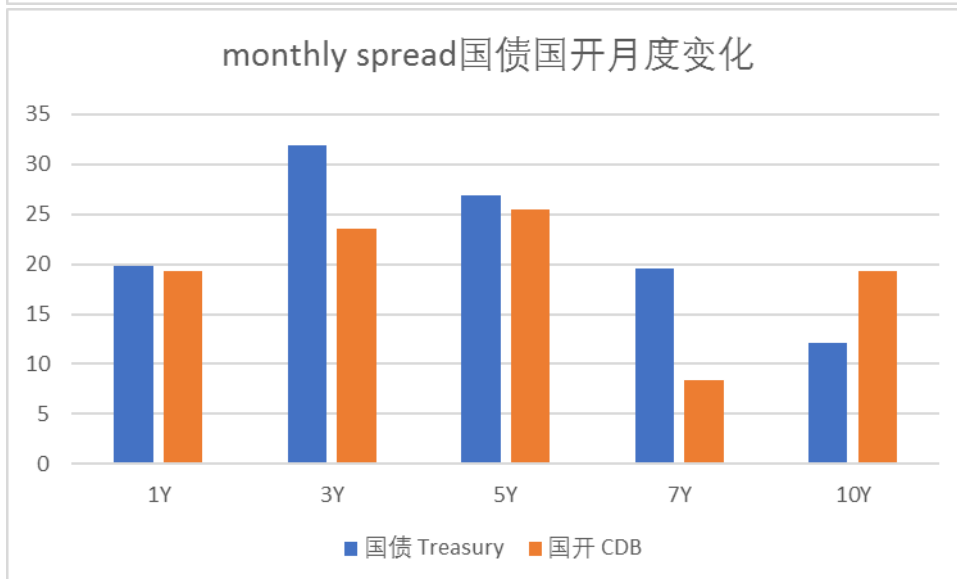
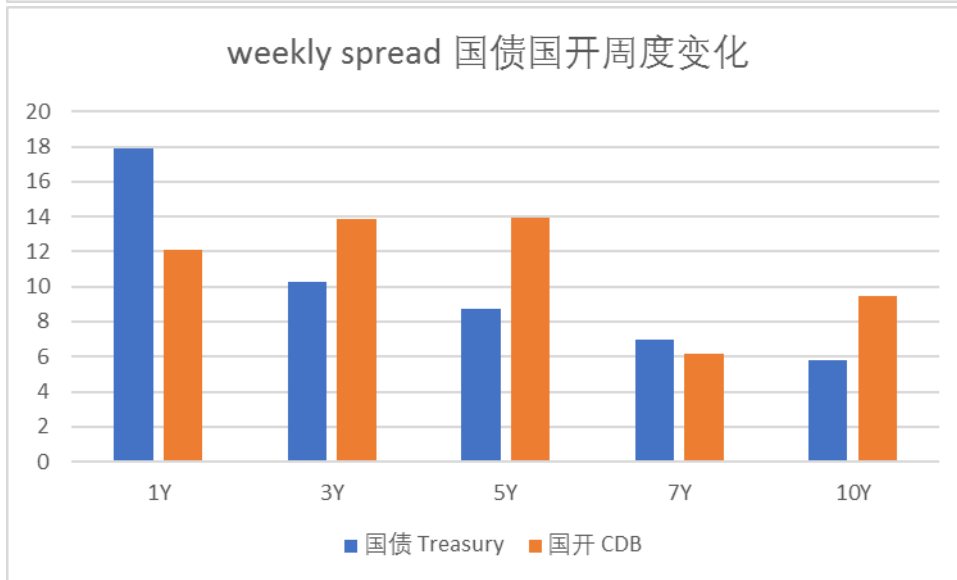
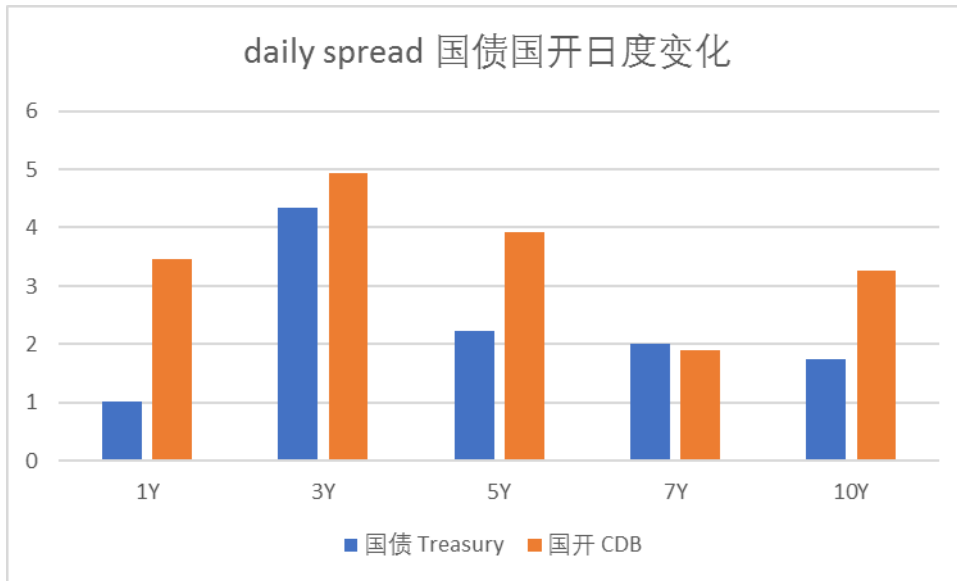
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	2.33	8	23	35	34686	4%
7天	2.27	-6	6	7	2561	-29%
14天	2.54	7	33	25	1459	38%
1月	2.45	2	6	6	66	3%
3月	2.70	29	34	35	12	274%

Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	2.36	10	23	37
7天	2.23	-5	2	3
14天	2.55	13	27	26
1月	2.36	2	6	11
3月	2.60	0	0	3
6月	2.81	1	3	12

数据来源：Wind

债券

1. 现券国债上行 1.5bp，国开上行 3.5bp。日内国债期货拉升，带动现券下行。尾盘传说国债一级放量发行，现券大幅上行。市场情绪偏弱，随着月底临近，大盘有向上突破的趋势。除非资金面和基本面都证伪，将迎来超预期下行，否则将突破向上至国债 3.1。

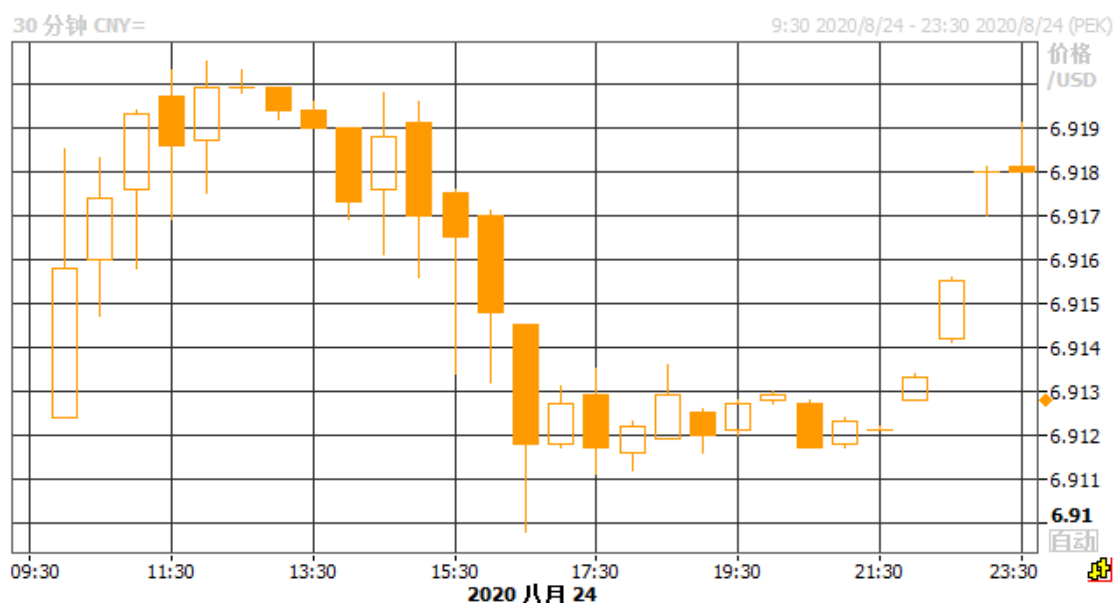


数据来源：Wind

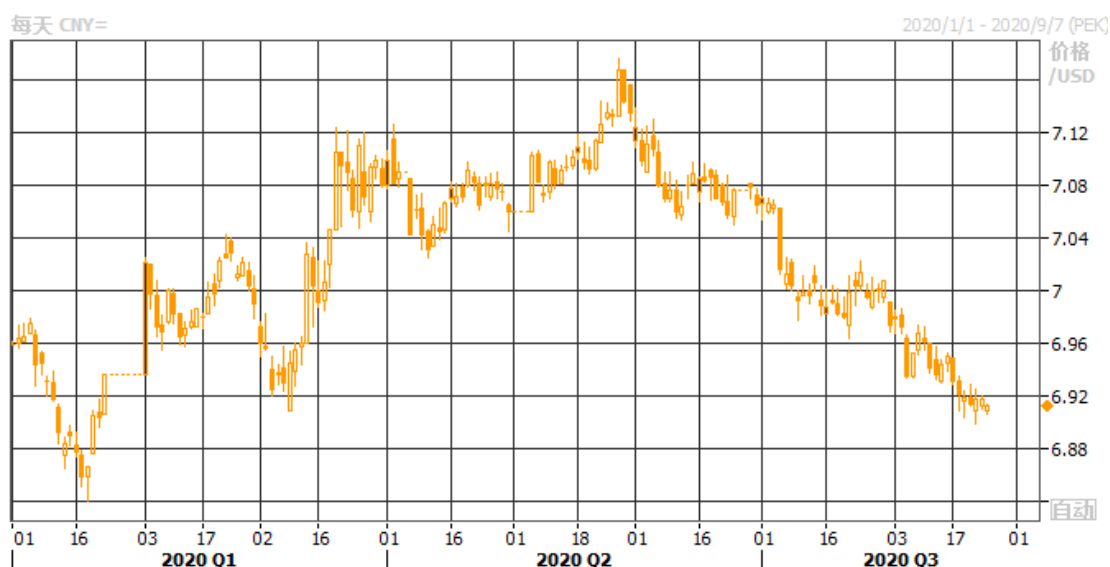
汇率

人民币兑美元即期周一收盘缩量微升至 6.9126, 中间价则暂时脱离七个月高位 6.9194。美国经济数据强劲改善美元人气前期空头获利了结也助稳美指, 不过美联储宽松政策料会限制美元反弹空间, 短期人民币或保持区间走势。目前中美关系持续紧张, 而且美国大选临近不确定性越高, 人民币走势或更为反复。本周市场目光将继续聚焦美国经济数据和美联储杰克森霍尔会议。

美元兑人民币 2020 年 08 月 24 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/08/24



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 :Bloomberg

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