

# 首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200828

## 货币市场

- 1.昨日公开市场 1600 亿到期，投放 1000 亿，净回笼 600 亿。另外开展 50 亿 3 个月 CBS。
- 2.即使净回笼，市场全天保持宽松，尾盘出现减点。

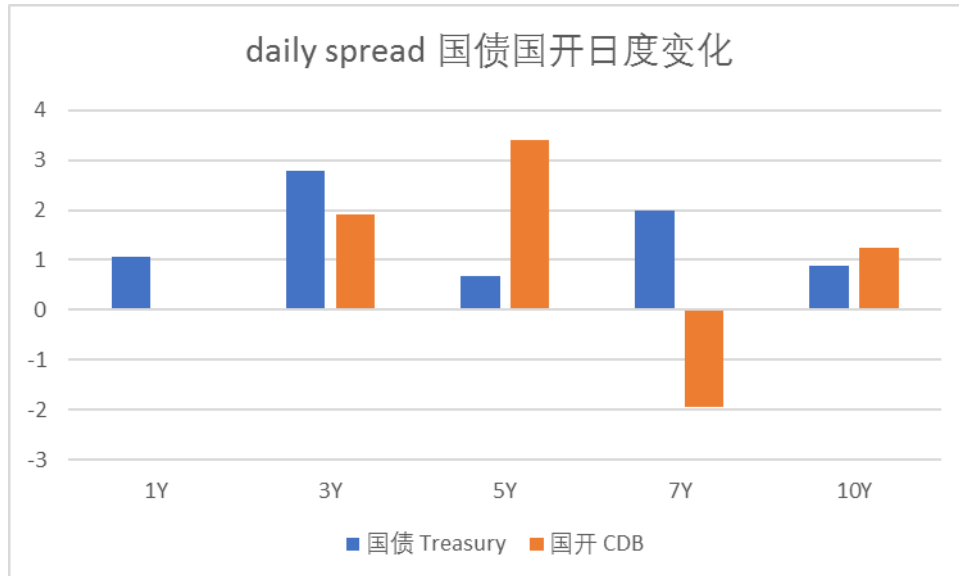
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.45	-16	-74	8	35415	2%
7天	2.15	-3	-12	-3	5215	-3%
14天	2.37	-4	0	12	586	31%
1月	2.35	-14	-5	8	20	-40%
3月	2.70	28	29	270	8	33%

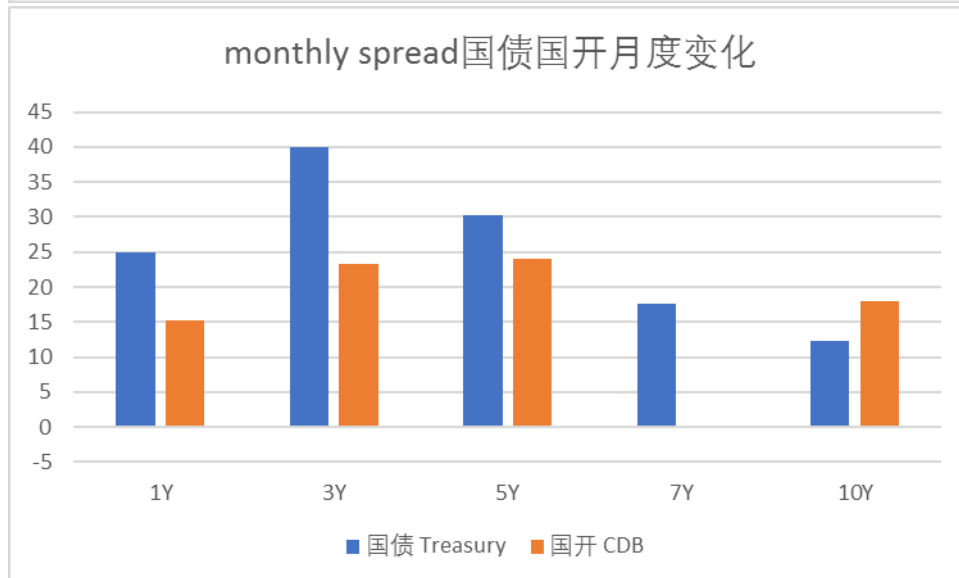
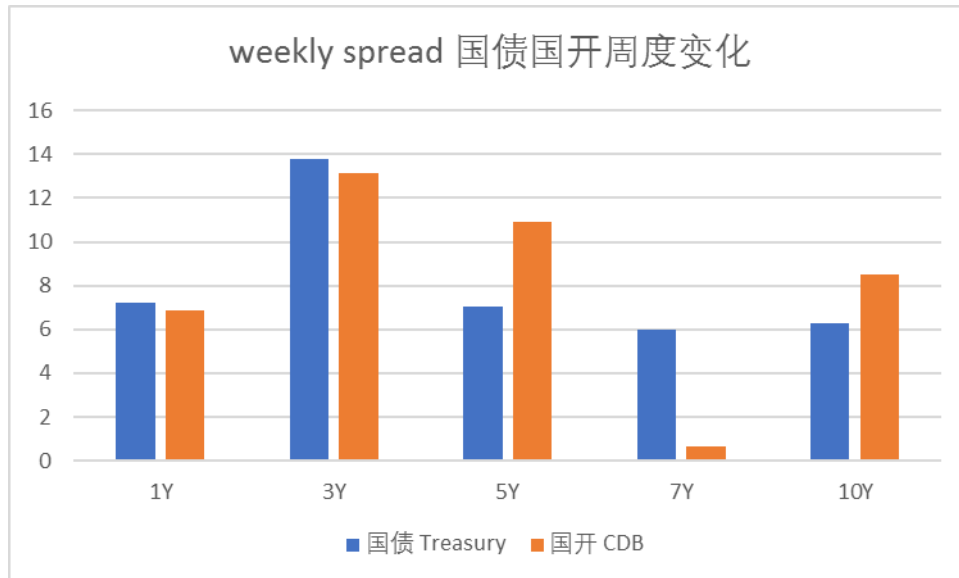
Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.48	-15	-70	11
7天	2.18	-4	-7	-0
14天	2.40	-7	6	16
1月	2.37	-0	5	8
3月	2.62	1	2	3
6月	2.83	1	3	12

数据来源：Wind

## 债券

1. 10 年国债二次探顶国债，但是未破前高。消息面平静，人民币继续升值。虽然盘中工业企业利润好于预期，但影响反而不大。收盘时，长债收益率明显上行。
2. 10 年国债和国开均上行 1-2bp。9 月供给压力有一定情绪面影响，但整体还是看央行态度。



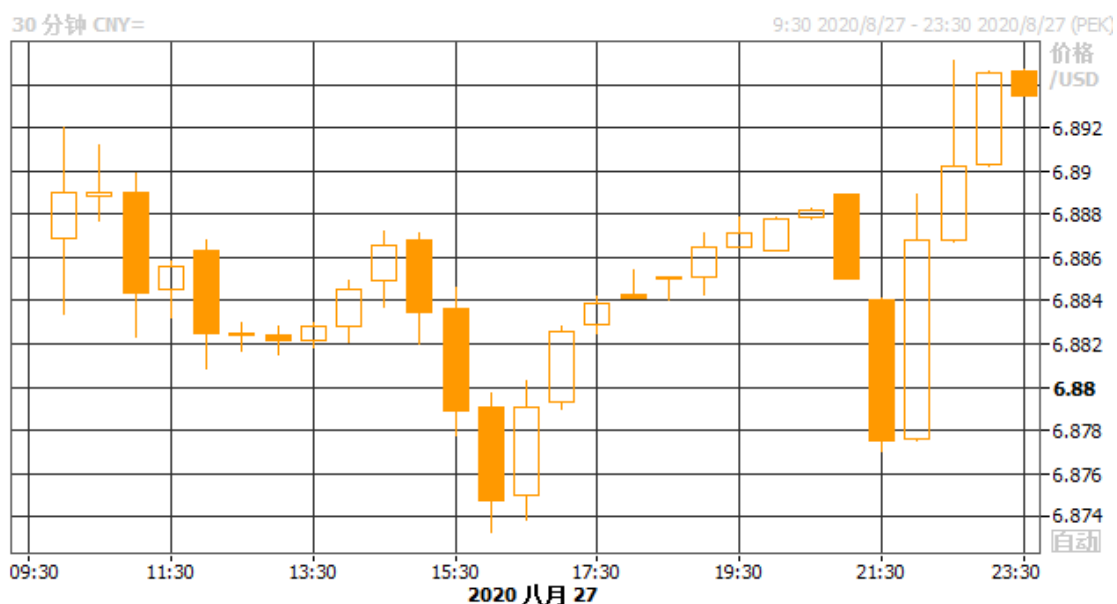


数据来源：Wind

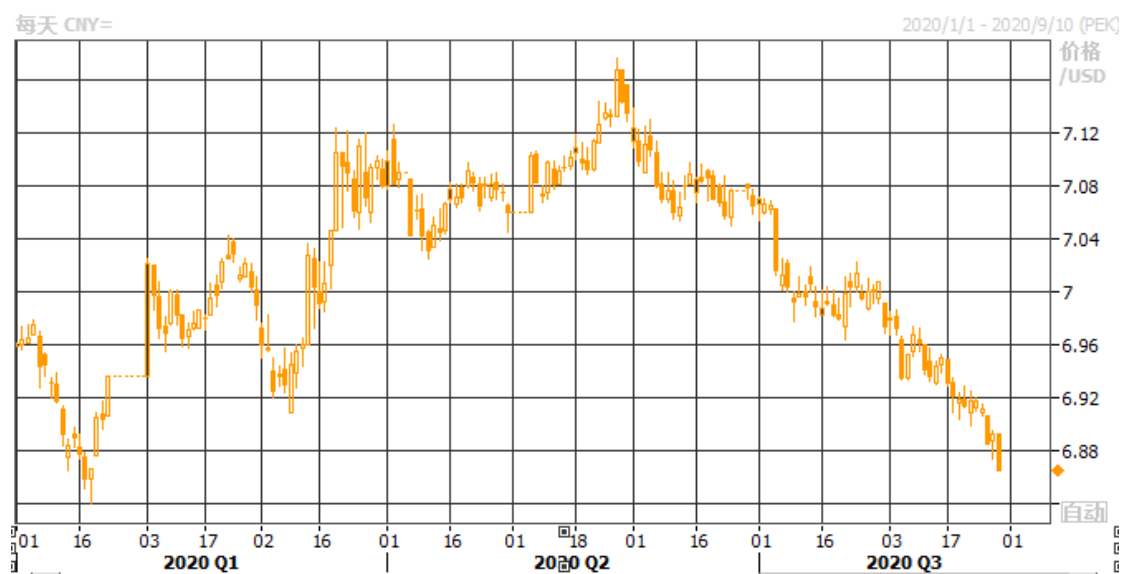
## 汇率

人民币兑美元即期周四收盘升逾 120 点并破 6.88 元关口，为逾七个月来首次跨过 6.88 元关口。中间价报于 6.8903。美指延续偏弱走势，加上中美贸易协议相关的风险出清，均对人民币构成支撑；考虑到中美利差较阔及中国经济持续从疫情中恢复，短期人民币料延续缓慢升值态势。中美第一阶段协议评估后市场风险偏好明显回升，这种关键不确定风险出清，料会逐渐改变此前整体偏弱表现，后续表现或更为强势；中美军事摩擦未来或将成为常态，只要不擦枪走火，对汇率的影响料有限。

## 美元兑人民币 2020 年 08 月 27 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/08/27



## 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](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)