

# 首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200901

## 货币市场

1. 昨日月末最后一天，公开市场到期 1000 亿，投放 200 亿，净回笼 800 亿，市场感受偏紧。
2. 资金利率上行，隔夜上行 40-50bp

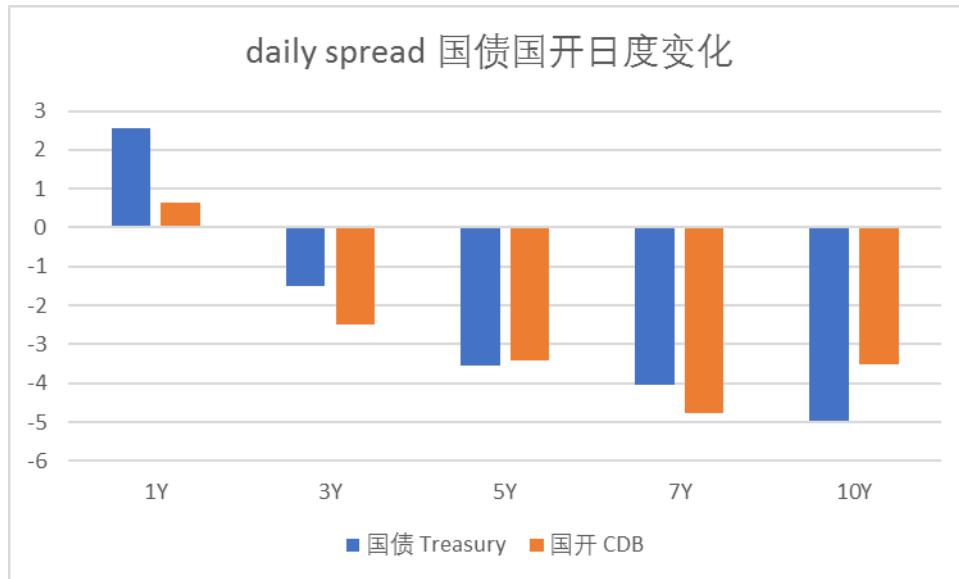
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.79	45	-54	22	23548	-28%
7天	2.25	2	-2	22	4528	-9%
14天	2.36	2	-18	47	323	37%
1月	2.45	245	-9	56	8	-69%

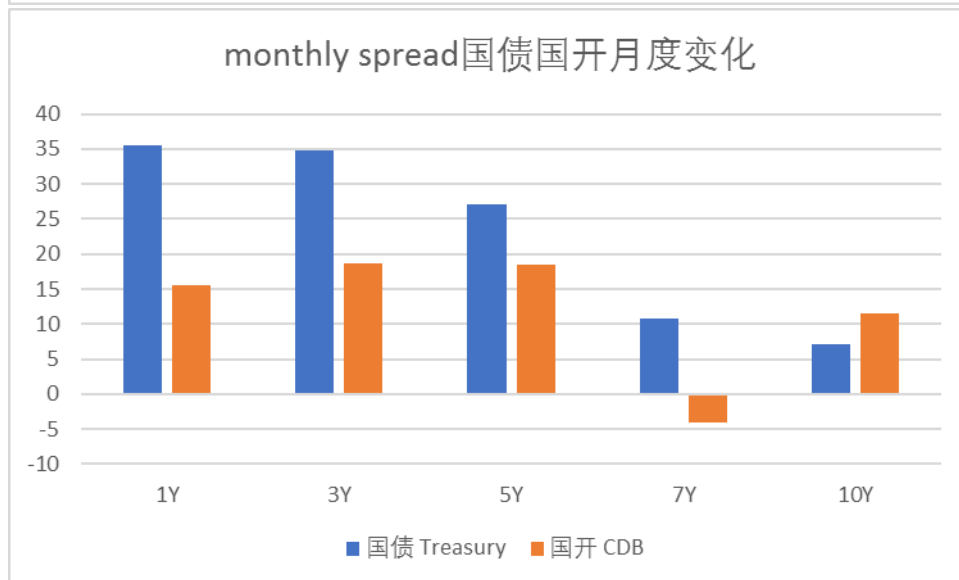
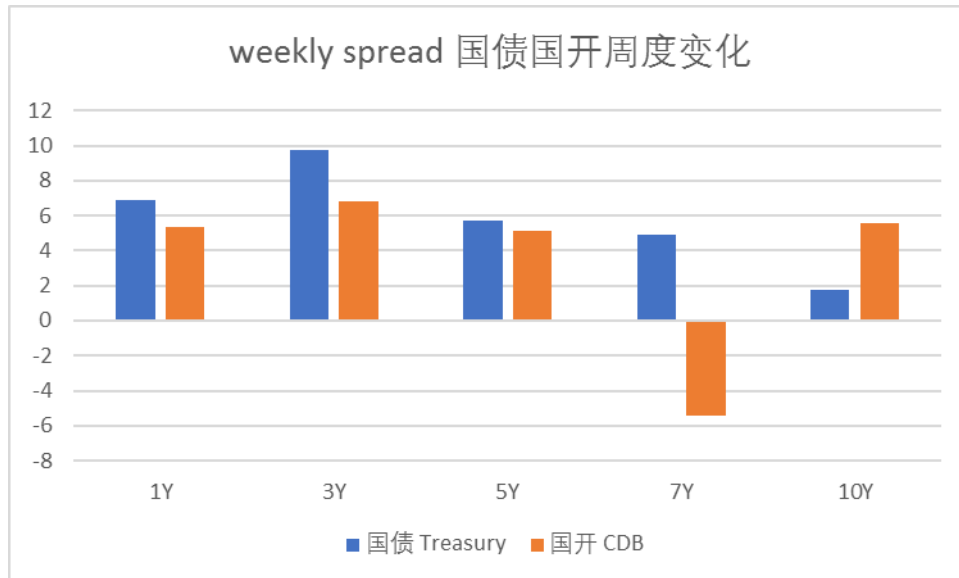
Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.77	42	-59	20
7天	2.23	-1	-0	19
14天	2.35	1	-20	40
1月	2.37	1	1	9
3月	2.64	1	3	4
6月	2.84	1	3	13

数据来源：Wind

## 债券

1. 昨天 PMI 数据略低于预期，供强需弱的情况 8 月继续，但生产微弱于上月，需求传导至库存引起的生产端的负反馈有所反映。
2. 尽管资金面偏紧，但现券单边下行，10 年国债下行 5bp，10 年国开下行 4bp。



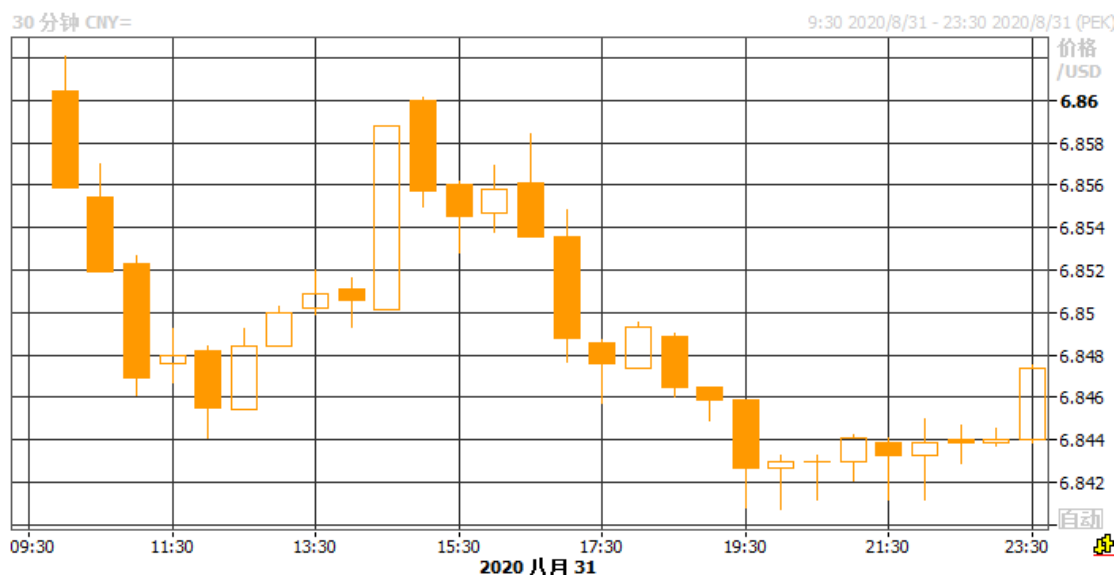


数据来源：Wind

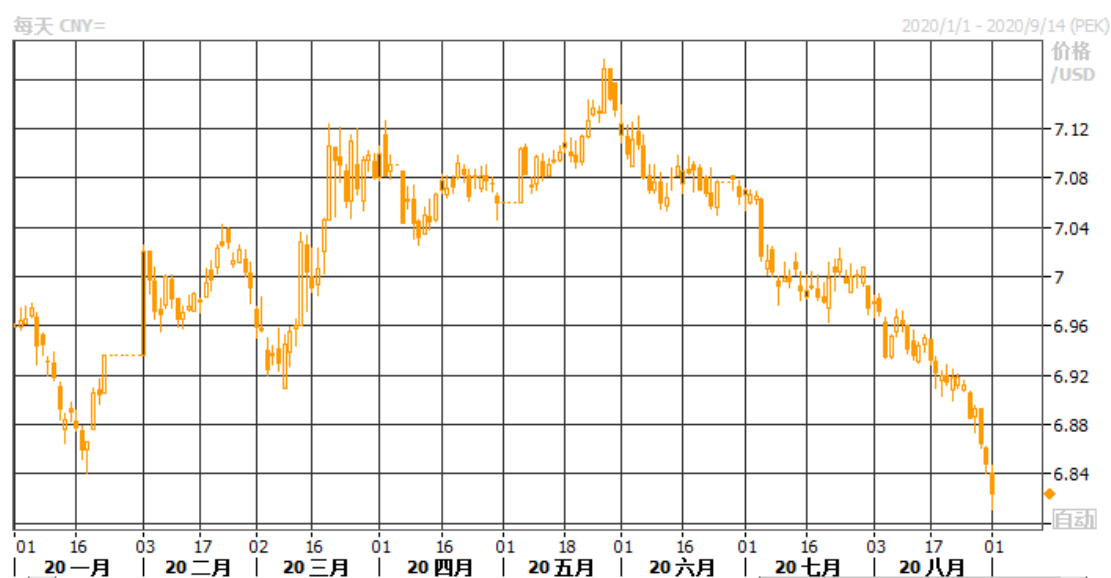
## 汇率

人民币兑美元即期周一收升近 120 点至 6.8535，与中间价均创 14 个月新高 6.8605，盘中与离岸 CNH 相继收复 6.85 元关口；但午后美指跌势收窄，且 A 股回吐涨幅，人民币也回吐部分涨幅。8 月人民币则累升 1.84%，为 2019 年 1 月以来最大单月涨幅。美指大概率延续弱势，而中美不确定性因素暂时降低，基本面因素也有利于人民币表现，市场做多人民币情绪升温，且预期趋于一致，每次调整仍是入场时机。

美元兑人民币 2020 年 08 月 31 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/08/31



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)