

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200902

货币市场

1. 资开市场大幅净回笼 2300 亿，2500 亿到期，投放 200 亿。
2. 金面先紧后松，跨月后资金利率继续上行。隔夜提升至 2% 以上。

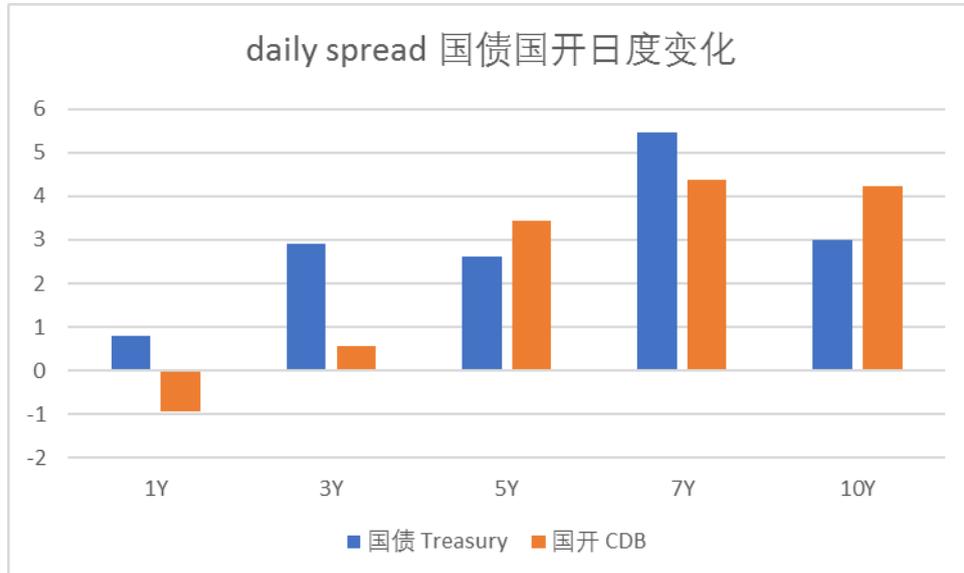
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	2.10	31	18	20	33394	42%
7天	2.19	-5	-2	8	4173	-8%
14天	2.20	-16	-32	20	623	93%
1月	2.10	210	-48	1	172	2003%
3月	2.62	17	22	60	13	1188%

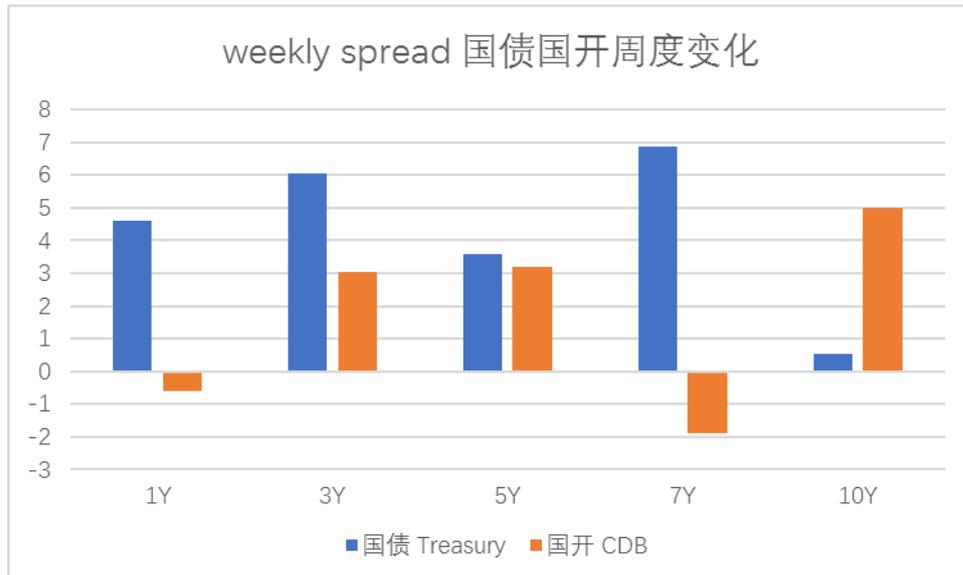
Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	2.10	34	14	18
7天	2.21	-2	-3	7
14天	2.24	-11	-31	20
1月	2.37	-0	0	9
3月	2.64	0	3	4
6月	2.85	0	3	11

数据来源：Wind

债券

1. 现券震荡，投标向好带动上午利率下行 2bp。然而午后，资金面始终偏紧，导致现券快速上行至收盘止损盘抛盘较多，全天利率上行。10Y 国债上行约 3bp，10Y 国开约 4bp。
2. 沪深 300 接近 5 年来历史最高，估值最贵阶段，偏空预期上升，对应现券维持震荡格局。



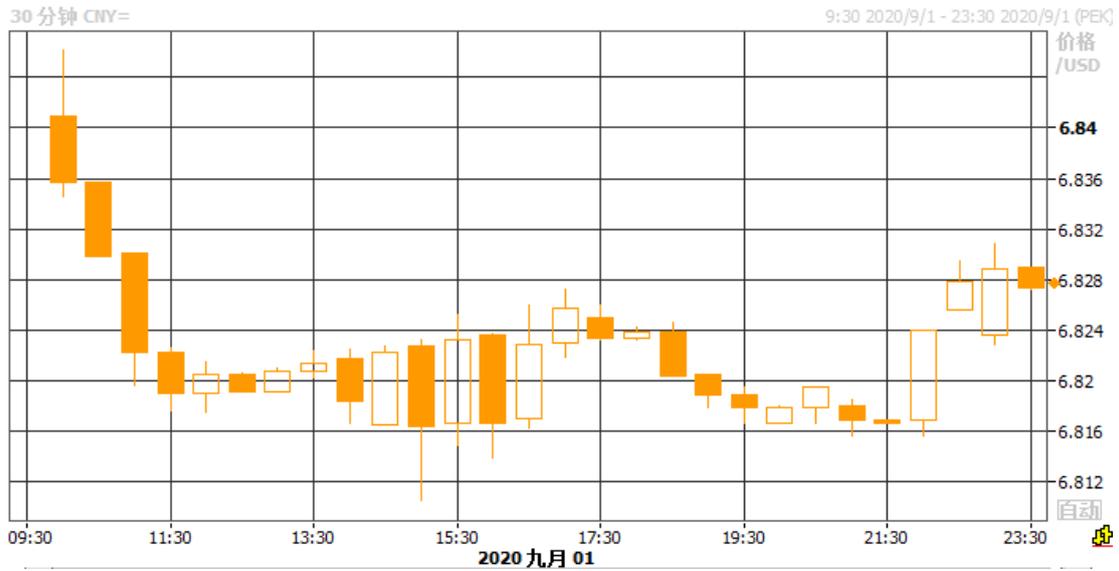


数据来源：Wind

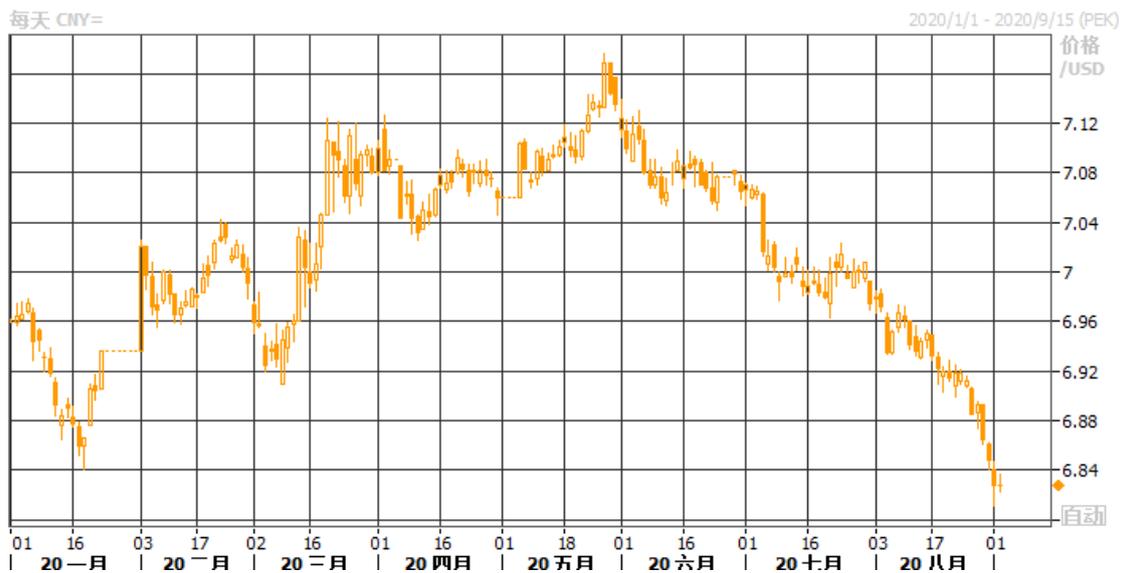
汇率

人民币兑美元即期周二收盘劲升近 300 点创近 16 个月新高 6.8239, 年内升幅已达 2.09%, 中间价亦创逾 14 个月新高 6.8498。美元指数破位下行持续提振市场做多人民币意愿, 在多个关键点位接连突破后, 购汇盘持续观望、结汇客盘涌出, 汇价加速走升。短期美指料延续跌势, 中市场看多人民币预期趋于一致, 若没有突发事件扰动, 人民币升值或难以阻挡, 汇价料继续靠近 6.8 关口。

美元兑人民币 2020 年 09 月 01 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/09/01



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