

# 首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200903

## 货币市场

1. 资金面早盘融出较少，午后宽松，尾盘减点。隔夜利率维持在 2%以上
2. 公开市场操作逆回购到期 2000 亿，投放 200 亿，净回笼 1800 亿。

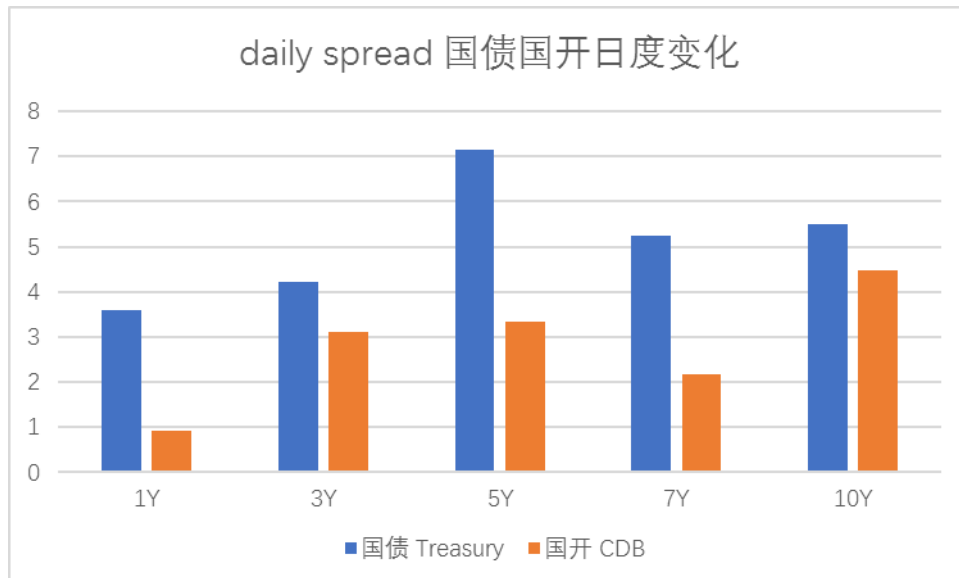
| 质押式回购利率<br>(存款类机构) | 利率   | 日变化 (bp) | 周变化 (bp) | 月变化 (bp) | 成交量   | 日变化  |
|--------------------|------|----------|----------|----------|-------|------|
| 1天                 | 2.07 | -4       | 45       | 40       | 34506 | 3%   |
| 7天                 | 2.19 | -0       | 1        | 18       | 4308  | 3%   |
| 14天                | 2.21 | 1        | -20      | 18       | 653   | 5%   |
| 1月                 | 2.13 | -5       | -36      | -2       | 210   | 22%  |
| 3月                 | 2.57 | 47       | 15       | 47       | 7     | -47% |

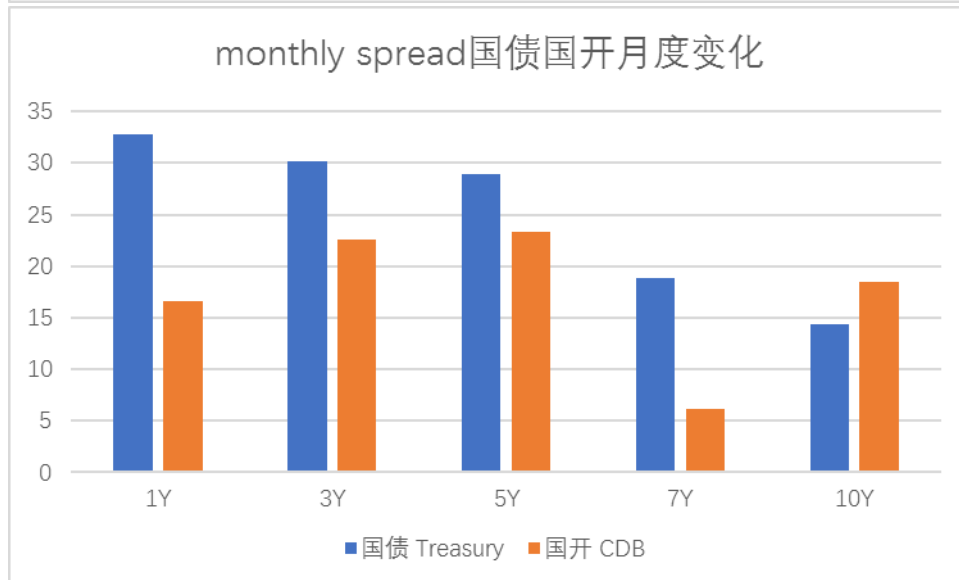
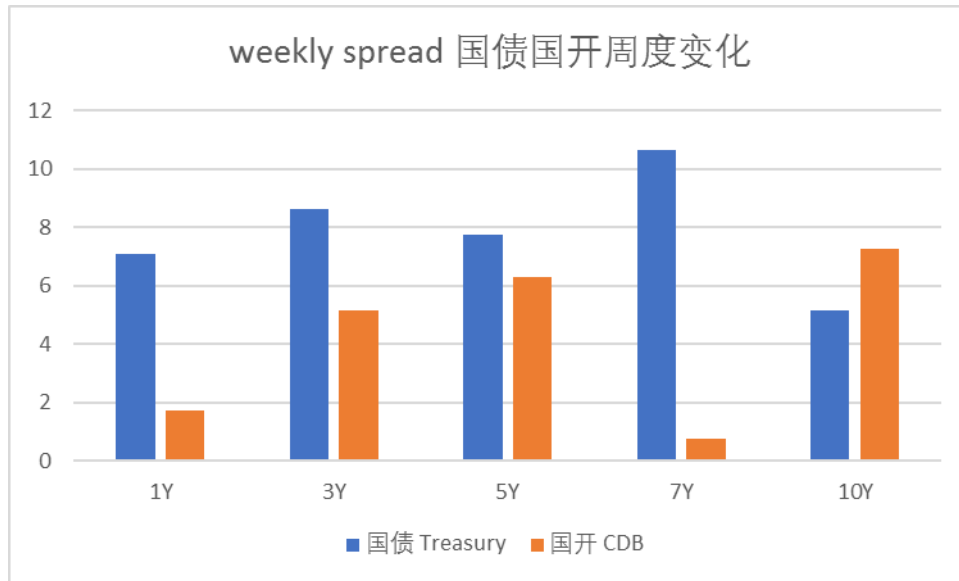
| Shibor | 利率   | 日变化 (bp) | 周变化 (bp) | 月变化 (bp) |
|--------|------|----------|----------|----------|
| 1天     | 2.09 | -1       | 46       | 40       |
| 7天     | 2.20 | -1       | -2       | 14       |
| 14天    | 2.23 | -2       | -24      | 19       |
| 1月     | 2.38 | 1        | 1        | 10       |
| 3月     | 2.65 | 1        | 3        | 5        |
| 6月     | 2.85 | 0        | 3        | 11       |

数据来源：Wind

## 债券

1. 两周钱央行超额续作 MLF，大额净投放 OMO 但是债市并没有大涨，主要还是预期提前打满，这几天的净回笼也一定程度上验证了市场的担忧。
2. 昨日市场继续上行，10Y 国债上行 5bp，10Y 国开上行 4bp。



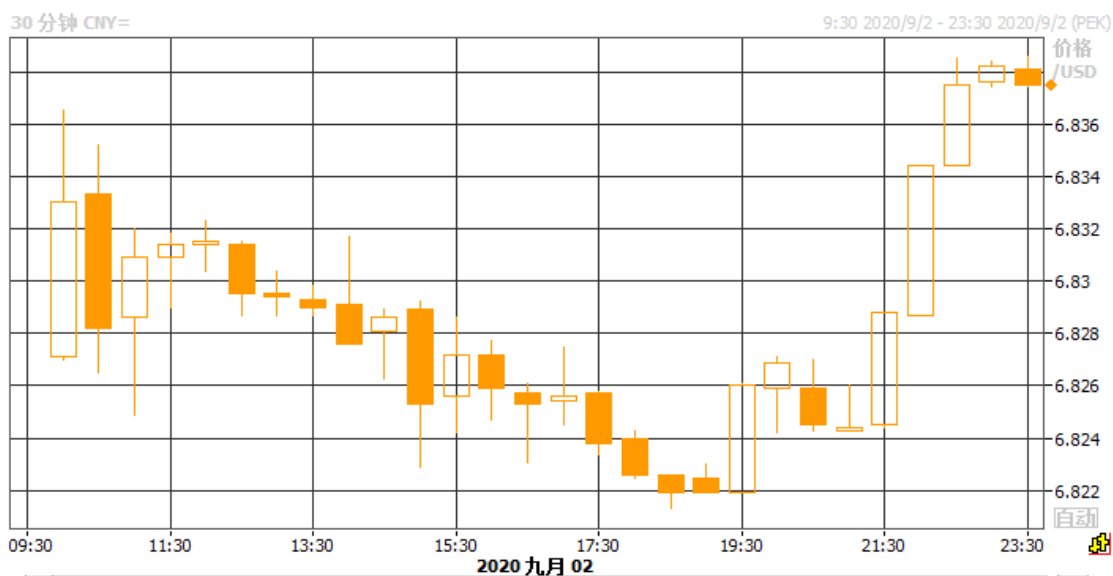


数据来源：Wind

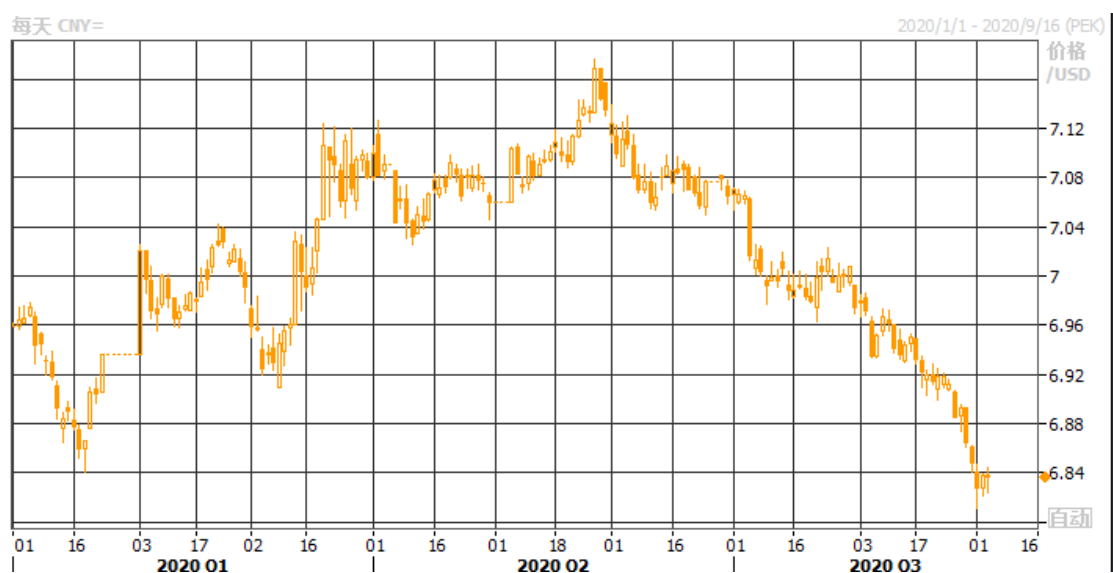
## 汇率

人民币兑美元即期周三收盘微跌至 6.8261，结束连八日升势，中间价则创近 16 个月新高 6.8376。隔夜美元指数自两年低点反弹，且中间价略弱于预期，令人民币升势暂缓；近日人民币升速较快，中间价略弱或表明监管层有意放缓人民币升势。另外欧洲经济复苏有所放缓，后续美元走势有一定不确定性；不过即使美元反弹，在基本面等多因素支持下，人民币调整空间也较为有限。市场看多人民币预期高度一致，汇价料短暂整固后进一步走升。

美元兑人民币 2020 年 09 月 02 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/09/02



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)