

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200904

货币市场

1. 公开市场投放 1200 亿逆回购，因为当日有 1000 亿到期，净投放 200 亿。
2. 早盘平衡宽松，午后略有收紧，隔夜加权利率在 1.8%左右。

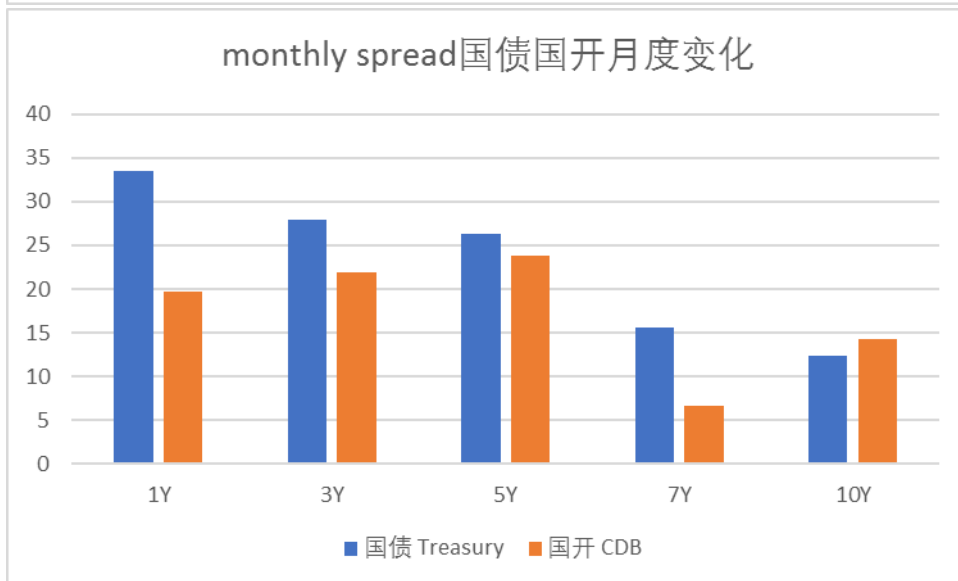
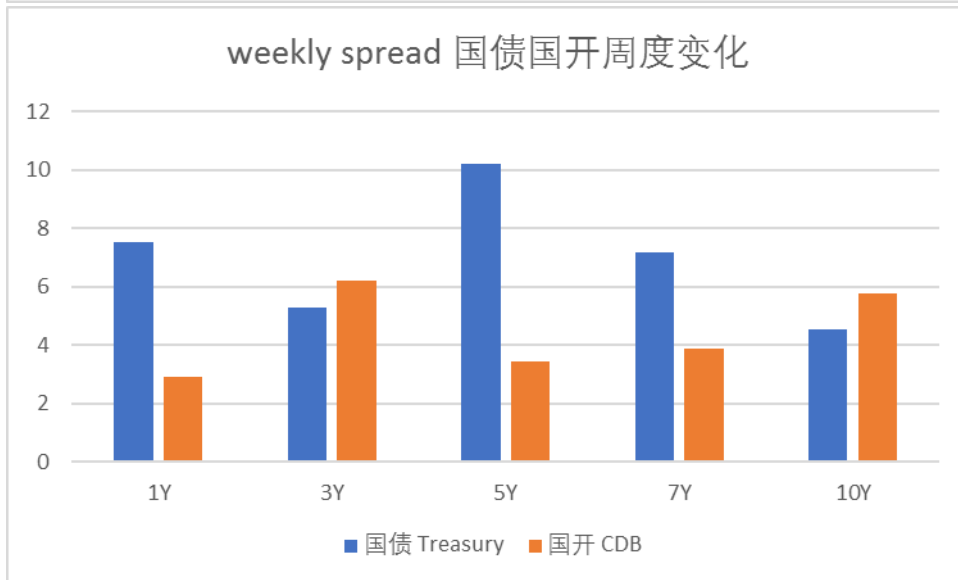
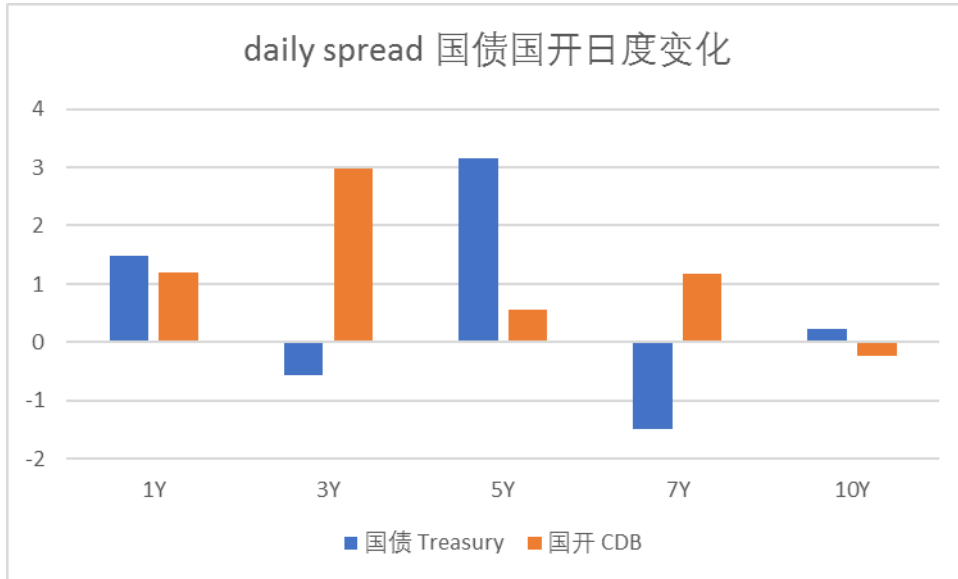
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.75	-32	30	8	35517	3%
7天	2.18	-1	2	16	4426	3%
14天	2.16	-5	-21	18	726	11%
1月	2.25	6	225	25	80	-62%
3月	2.56	43	20	32	10	48%

Shbor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.74	-35	27	8
7天	2.20	-0	2	12
14天	2.19	-4	-21	17
1月	2.39	1	2	10
3月	2.65	1	3	5
6月	2.86	1	4	11

数据来源：Wind

债券

1. 上午现券开盘下跌，国债 3.10 关口有所支撑，午后国债期货拉升，带动现券收益率高位下行。全天收盘基本持平于前一天。
2. 银行负债压力仍然高启，存单利率难以下行。现券收益率易上难下，尽管央行尚未加息，但市场已把预期提前 price in，导致今年的利率上行早于 2017 年的周期。



数据来源：Wind

汇率

人民币兑美元即期周四收报 6.8355 较上日收跌近百点 ,中间价亦小幅调降至 6.8359。

隔夜市场欧元回落、美元反弹，人民币在连续快涨后，周四继续在 6.82-6.84 元区间振荡整理。人民币走势在亚币中仍然偏强。

人民币在短期震荡整理后仍然看涨，预计人民币短期震荡回调后将测试 6.80 关口为关键阻力位。周五晚间美国将公布非农就业数据。

美元兑人民币 2020 年 09 月 03 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/09/03



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