

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200907

货币市场

1. 上周五公开市场净投放为 0，当日有 1000 亿到期，投放 1000 亿。
2. 全天资金面平衡略偏紧，隔夜利率回升至 2%以上。

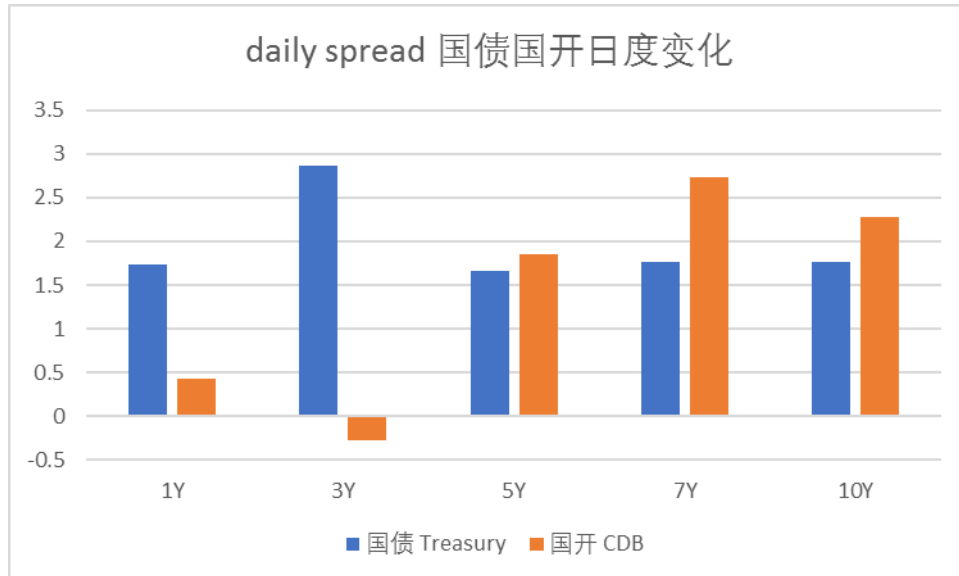
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	2.04	29	69	-2	35074	-1%
7天	2.21	3	-2	0	4032	-9%
14天	2.26	10	-8	21	797	10%
1月	2.15	-7	215	15	50	-37%

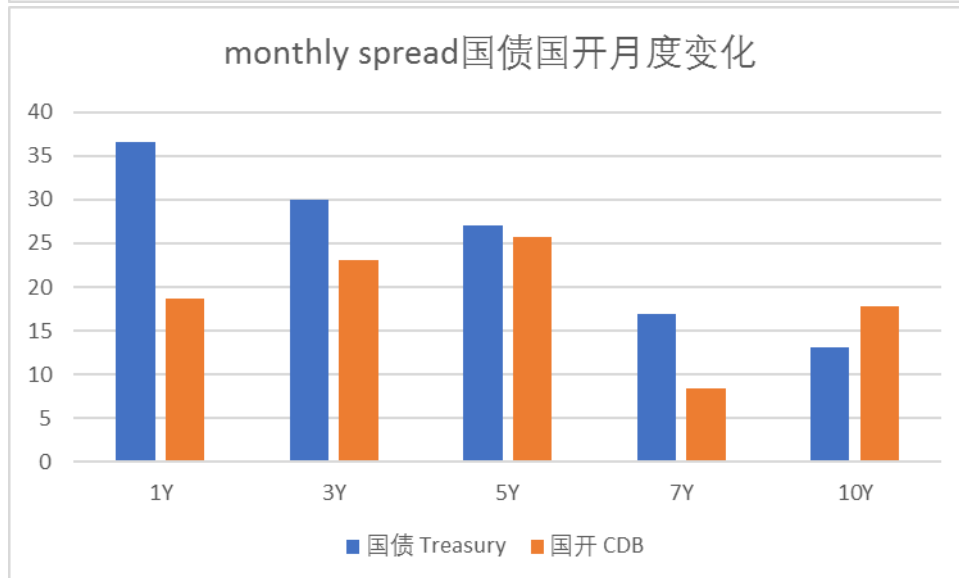
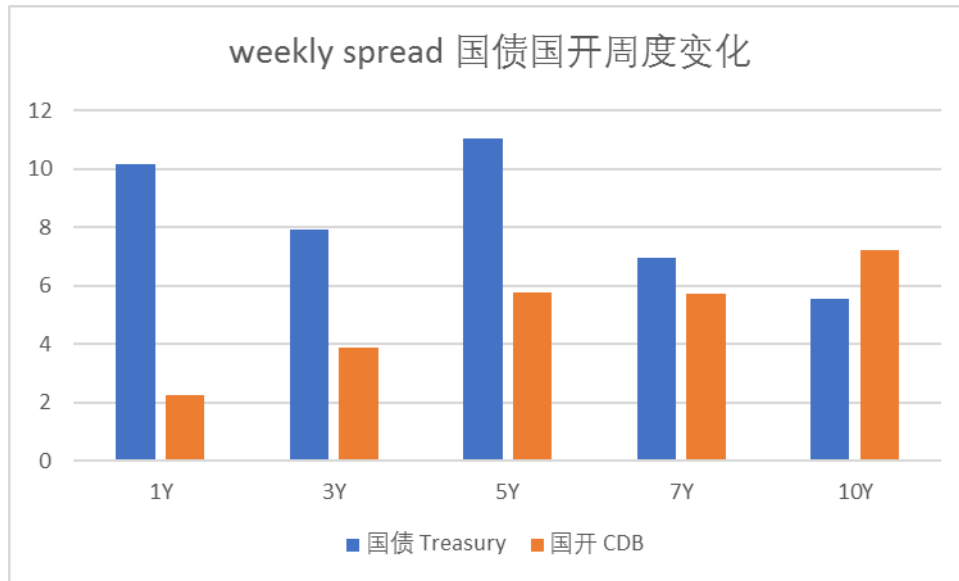
Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	2.05	31	71	-0
7天	2.21	1	-2	1
14天	2.22	3	-12	17
1月	2.40	1	3	11
3月	2.66	1	3	6
6月	2.87	1	4	12

数据来源：Wind

债券

1. 尽管前一晚美股大跌，美债收益率明显下行，当天国债期货高开，但资金面均衡，同业存单利率继续上行，对债市情绪面影响为偏空。
2. 另外周一将公布进出口数据，卖方预期出口增幅为 10-12%，且该月为传统的数据较好的月份，对基本面的预期推升尾盘大幅拉升。全天 10Y 国开和国债分别上行 1-2bp。



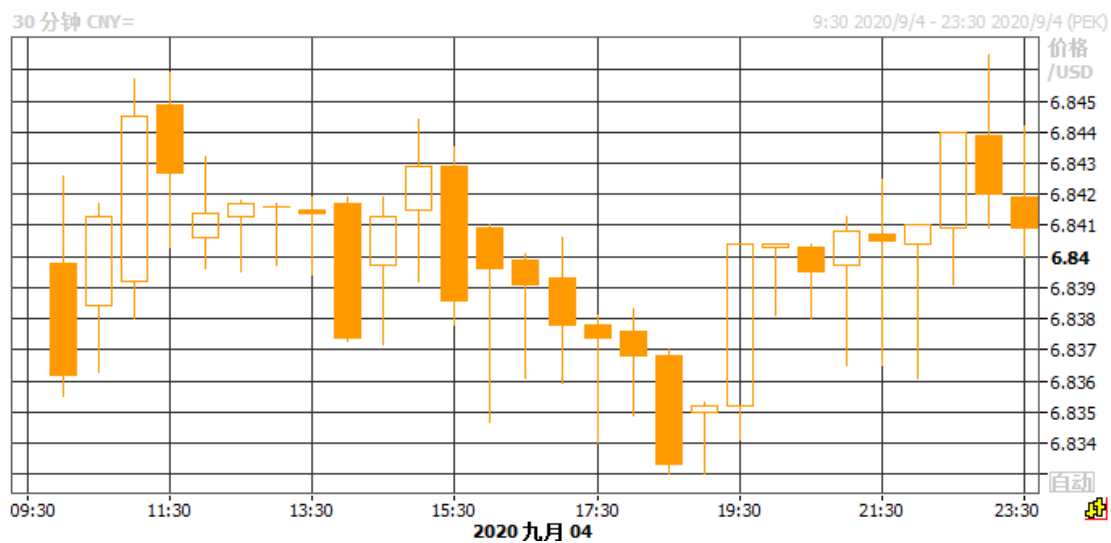


数据来源：Wind

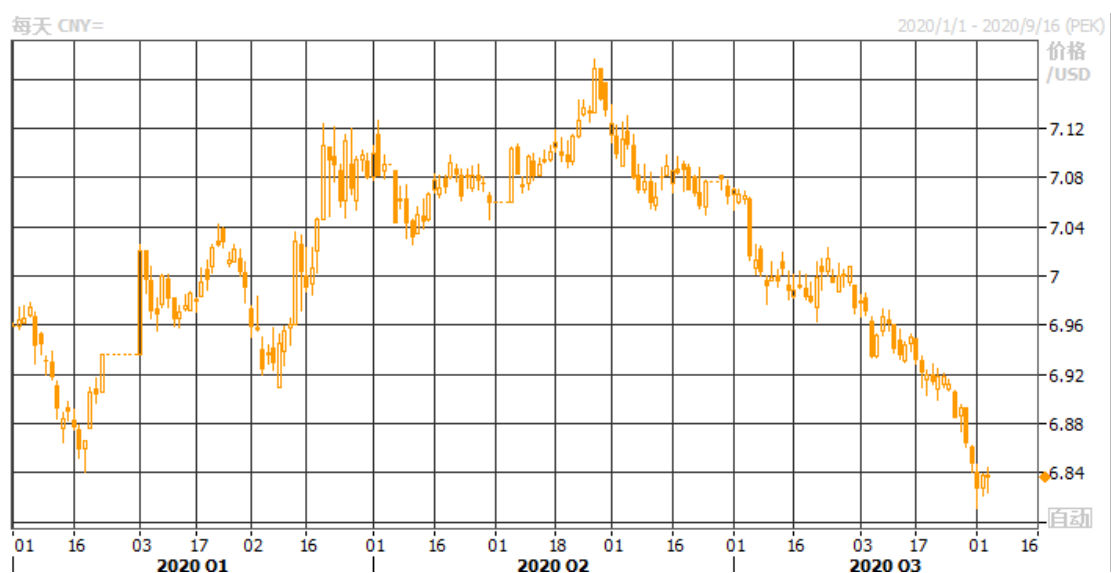
汇率

人民币兑美元即期周五连三日收跌,成交量剧降近三成,中间价亦转跌结束连八日升势。美元指数反弹并整固涨幅,且人民币多头止盈较多,市场高昂的看涨情绪亦渐归平静;关注稍晚美国非农就业数据情况,寄望获得人民币下一步走势指引。市场预期美联储将维持宽松政策,继续看跌美元后市,不过短期存在技术性反弹可能;另外美大选前中美紧张关系恐进一步升温,且近日地缘政治再起波澜,均可能加剧人民币波动。

美元兑人民币 2020 年 09 月 04 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

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