

# 首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200910

## 货币市场

1. 公开市场投放 1200 亿,到期 200 亿,净投放 1000 亿。
2. 资金面持续宽松, 资金利率大幅下行至隔夜利率 1.6%。

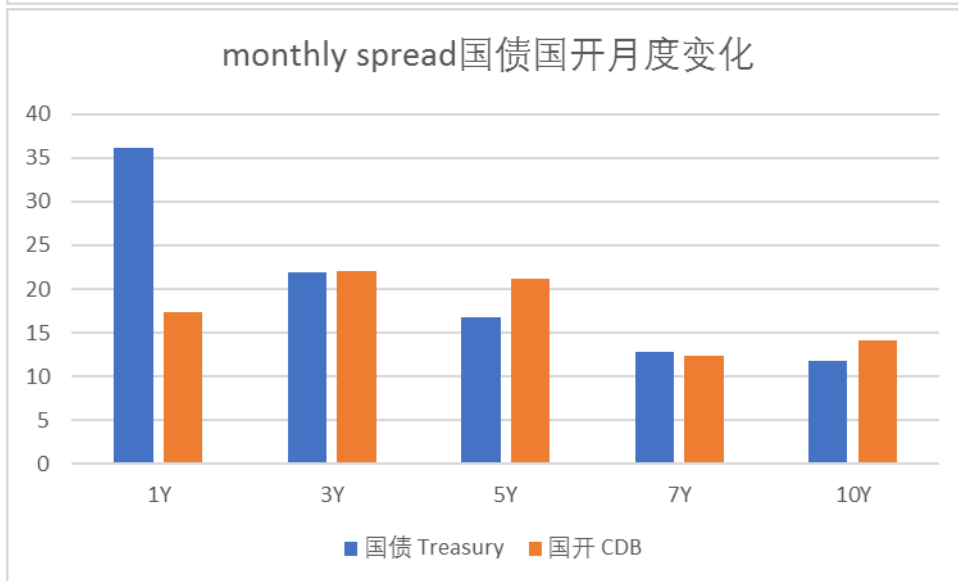
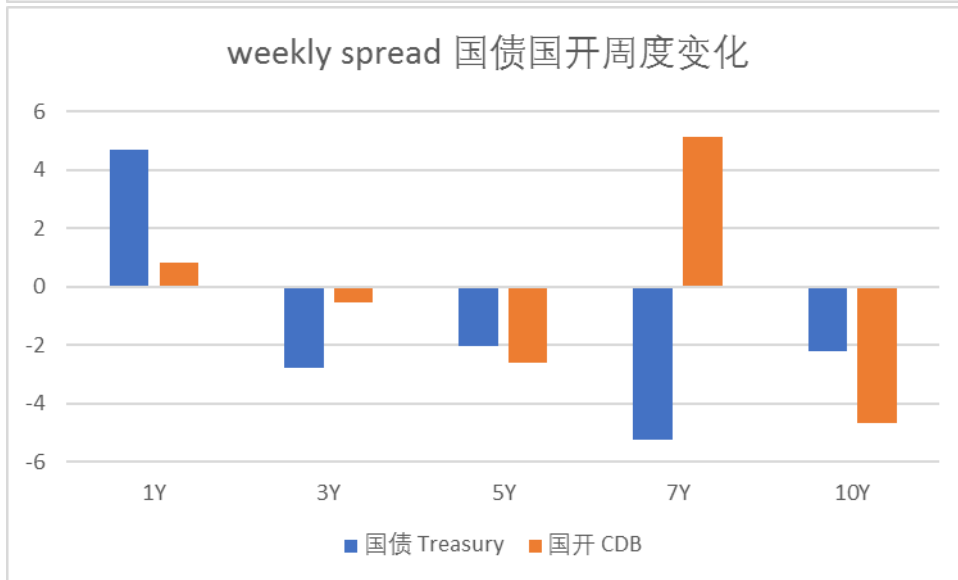
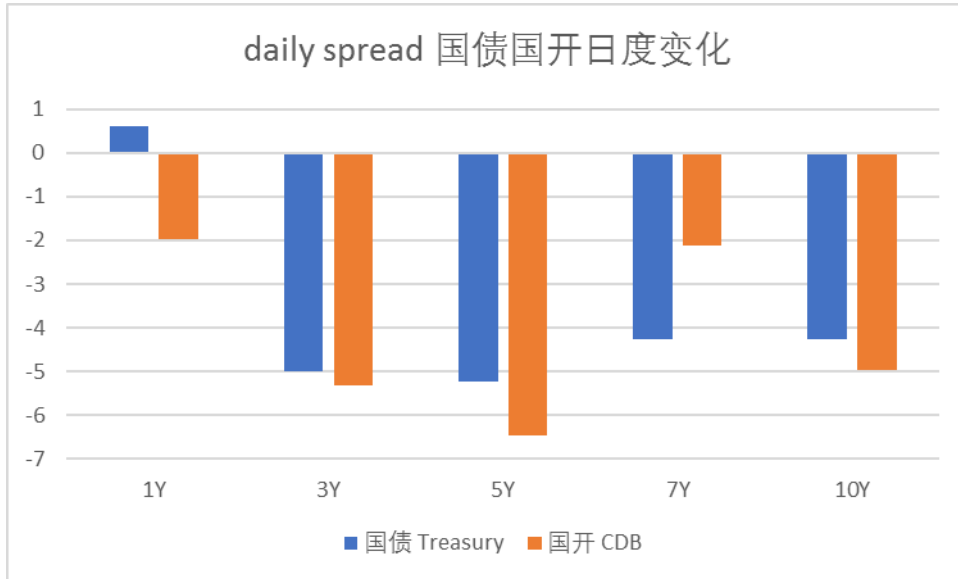
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.60	-43	-47	-55	37637	2%
7天	2.16	-4	-3	-8	3947	0%
14天	2.14	-12	-7	-13	669	5%
1月	2.71	41	52	33	125	161%
3月	2.69	3	56	33	6	3%

Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.61	-44	-49	-55
7天	2.19	-2	-1	-5
14天	2.20	-4	-2	-7
1月	2.50	3	12	20
3月	2.69	0	5	9
6月	2.91	1	6	15

数据来源：Wind

## 债券

1. 资金面宽松, CPI 同比 2.4%与预期一致, PPI 同比-2.0%预期-1.9% 略低于预期, 市场对此前基本面的过度乐观预期有所收敛, 空头转入观望。现券各期限下行 4-6bp, 尤其 5 年下行幅度最大。
2. 美股连续下挫, 以及原油进入需求冷淡期价格偏空, 带动美债下行。

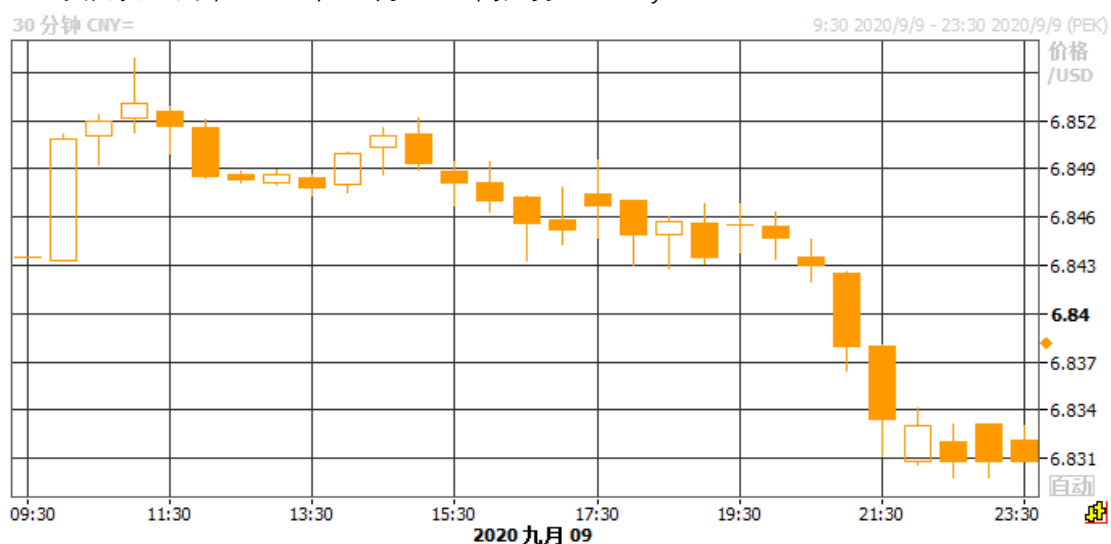


数据来源：Wind

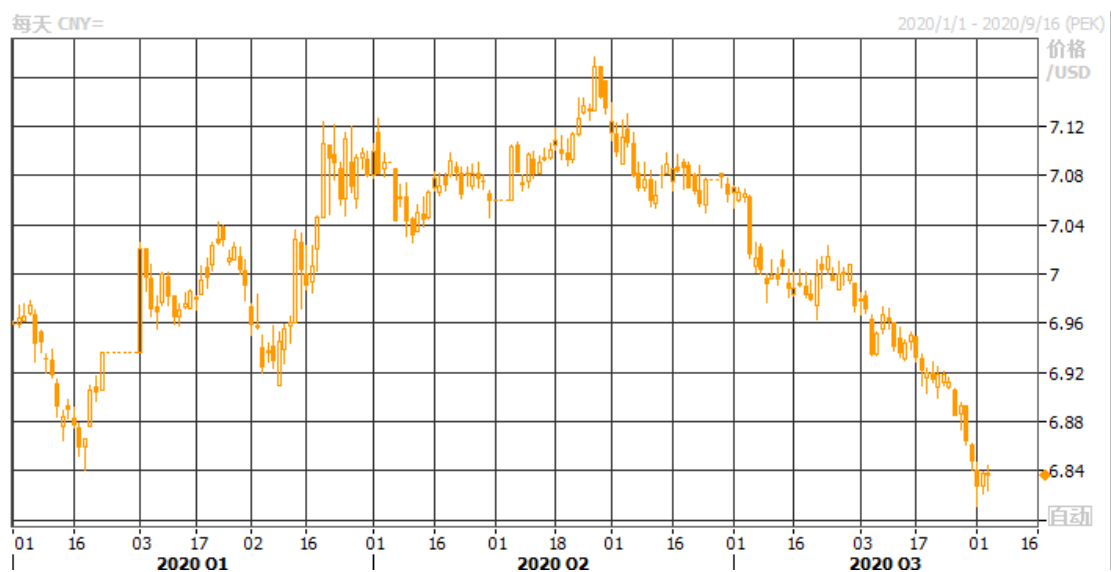
## 汇率

人民币兑美元即期周三放量收跌至 6.8460，与中间价同创逾一周新低 6.8423。隔夜美股下跌及疫苗延迟等刺激市场避险情绪，人民币亦承压下行，不过午后美指小幅转弱，人民币跌幅收窄，市场将关注焦点转向周四欧洲央行会议，欧元调整可能间接拖累人民币表现。中美在各个领域的摩擦日渐升级，大选临近这种状况只会更加恶化，对人民币而言，外部环境复杂化也会限制汇率表现，短期汇率大概率延续在 6.86-8.81 区间宽幅震荡，等待更多指引。。

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



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)