

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200911

货币市场

1. 央行公开市场操作当天有 1200 亿逆回购到期，投放 1400 亿，净投放 200 亿元。
2. 资金面全面宽松，资金价格维持在低位。

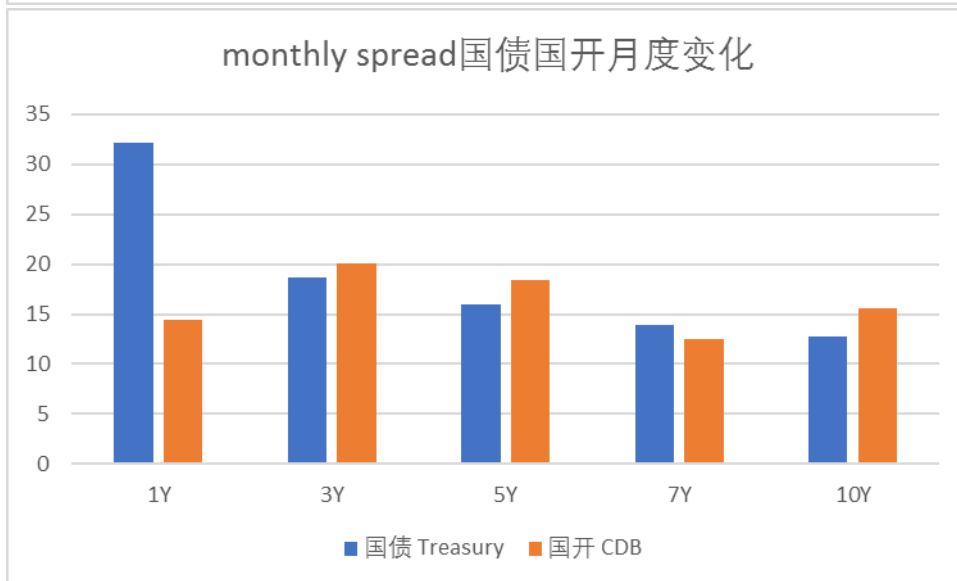
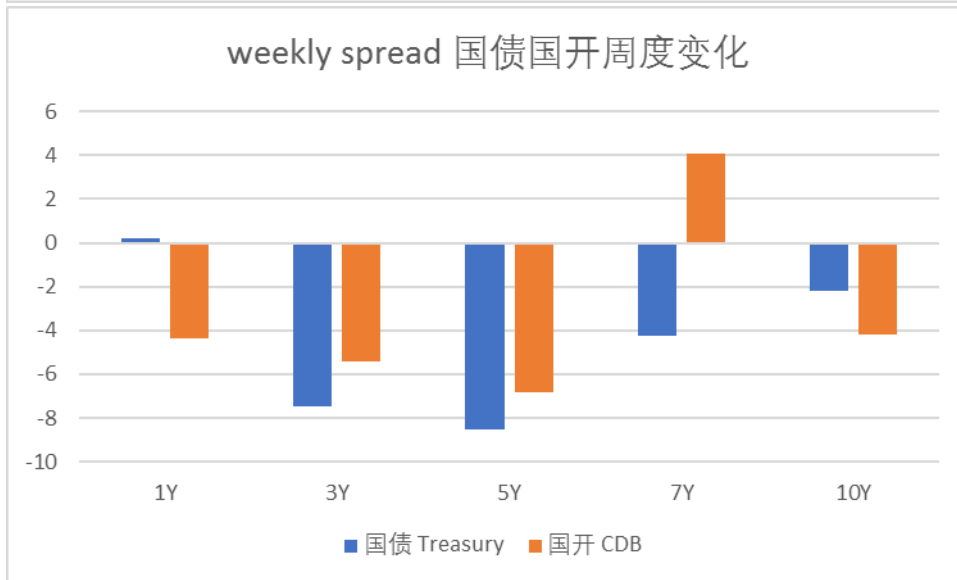
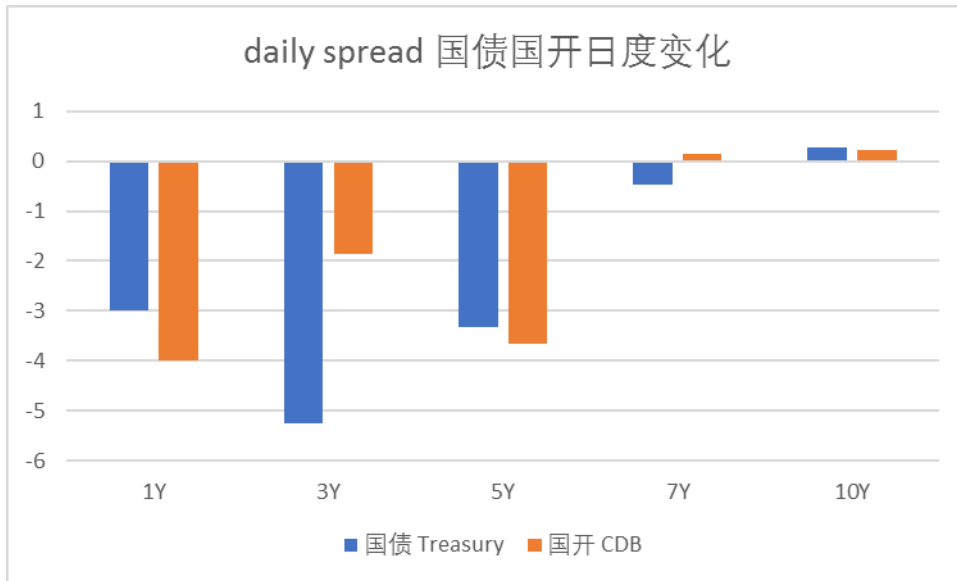
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.34	-26	-41	-83	40286	7%
7天	2.05	-11	-12	-18	3703	-6%
14天	2.13	-0	-2	-16	738	10%
1月	2.70	60	47	33	202	62%
3月	2.85	14	60	51	12	96%

Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.34	-27	-40	-82
7天	2.13	-6	-7	-11
14天	2.17	-3	-2	-12
1月	2.54	4	15	24
3月	2.70	0	4	9
6月	2.93	2	6	16

数据来源：Wind

债券

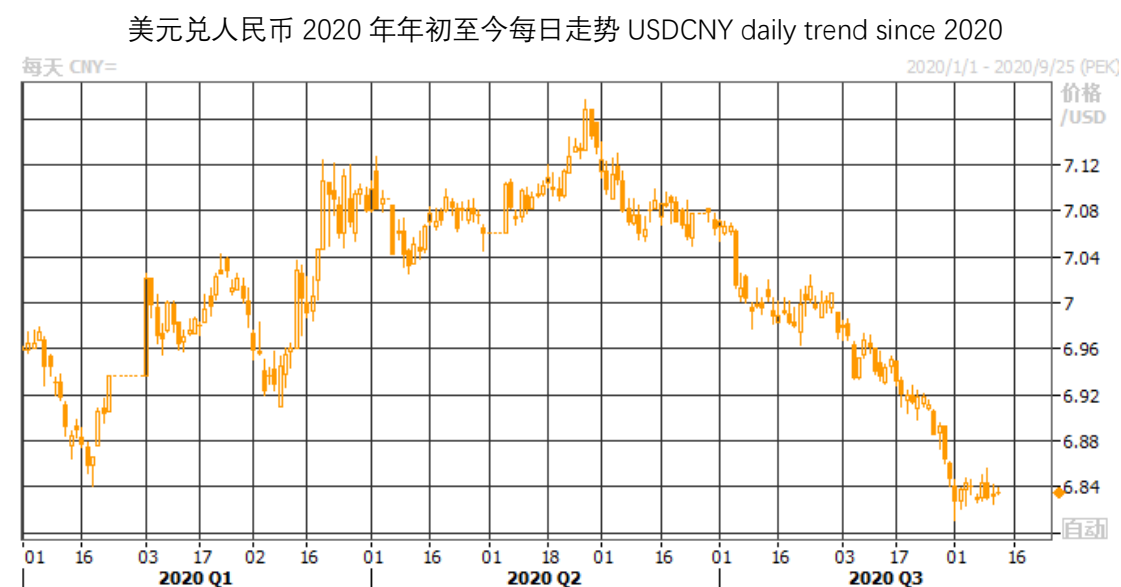
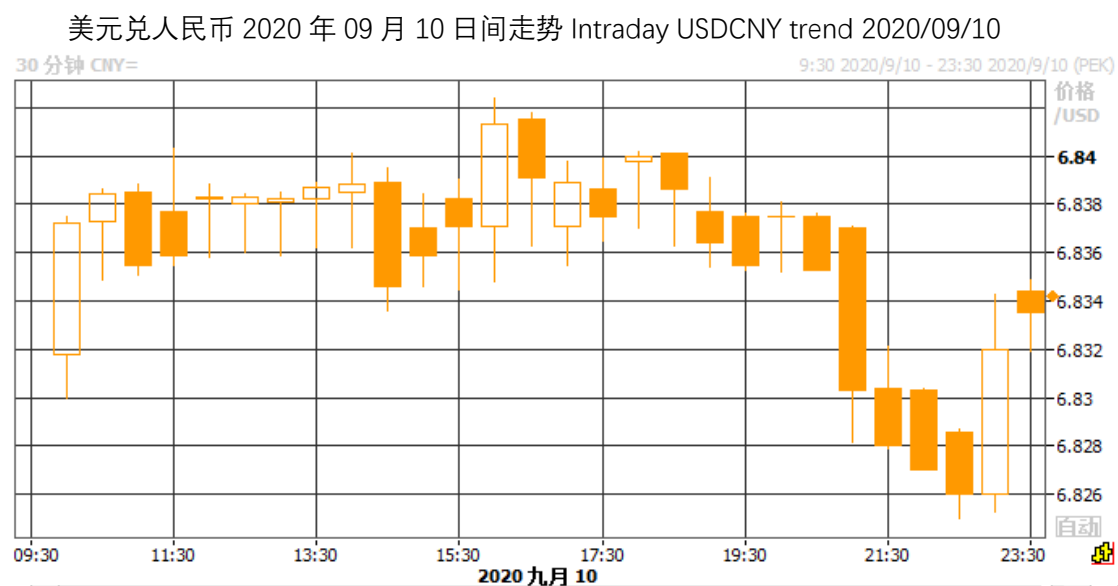
1. 现券延续前一天上涨趋势，对基本面维持观望状态，空头有所收敛。全天国债期货上行冲刺 98.4 阻力位，现券继续下行尤其中短端。但尾盘由于即将周五，对社融和其他经济数据的预期不稳，市场对持券的焦虑感上升，长端回调至与开盘基本持平的位置。
2. 8 月经济数据依然较上月有所回升，由于前期 price in 过于充分，市场观望是否有超预期的部分。



数据来源：Wind

汇率

人民币兑美元即期周四收盘小升至 6.8398，中间价亦升近百点至一周高位 6.8331；隔夜美股反弹，避险情绪缓和推低美元指数人民币跟随反弹，不过日内波幅较为有限；短期汇价维持盘整走势，关注欧洲央行会议以寻求方向。欧洲央行对偏强欧元会否采取更多举措，会通过美元影响人民币；不过美股走势以及中美局势动向等，仍是人民币汇率关键外部不确定因素。



数据来源 :Bloomberg

免责声明：本文所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