

首都银行（中国）利率汇率市场日评

20200914

货币市场

1. 央行流动性维持合理充裕，当天到期 1000 亿， 投放 900 亿， 净回笼 100 亿。
2. 资金利率周内下行较多， 尤其隔夜在 1.5%左右的很低位置。但跨月需求开始上升。

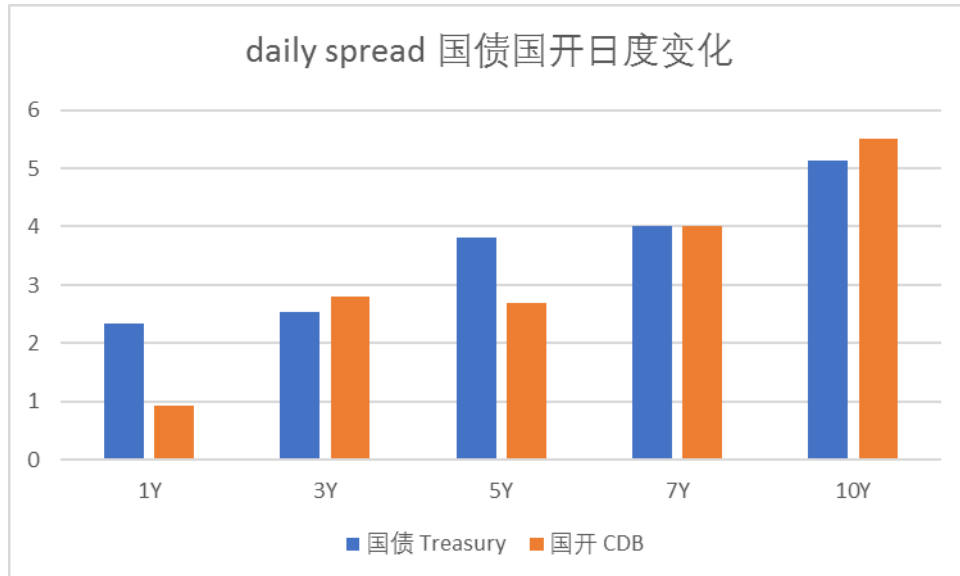
质押式回购利率 (存款类机构)	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)	成交量	日变化
1天	1.46	12	-58	-71	39964	-1%
7天	2.09	4	-11	-12	3553	-4%
14天	2.13	-0	-13	-17	397	-46%
1月	2.73	57	43	35	251	24%
3月	2.81	11	66	42	23	90%

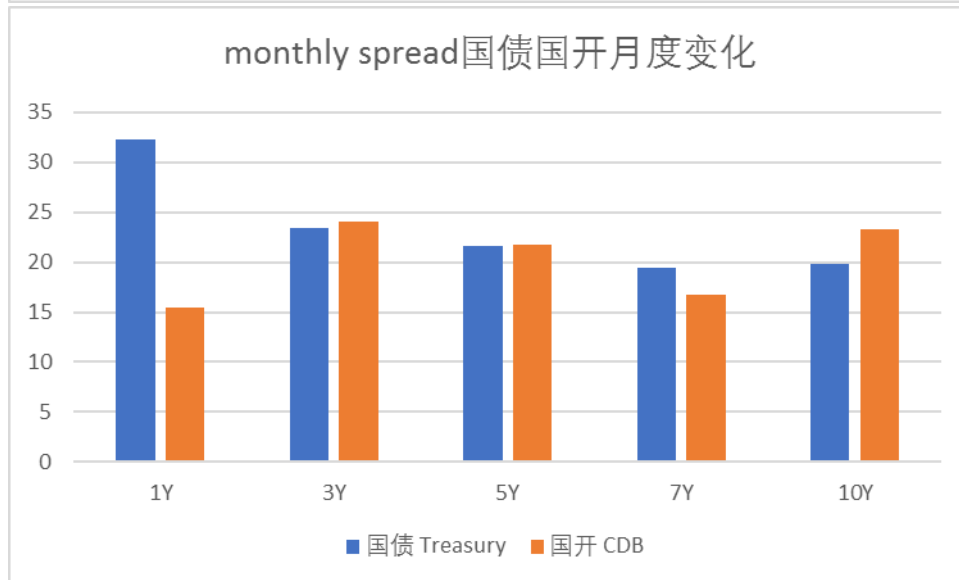
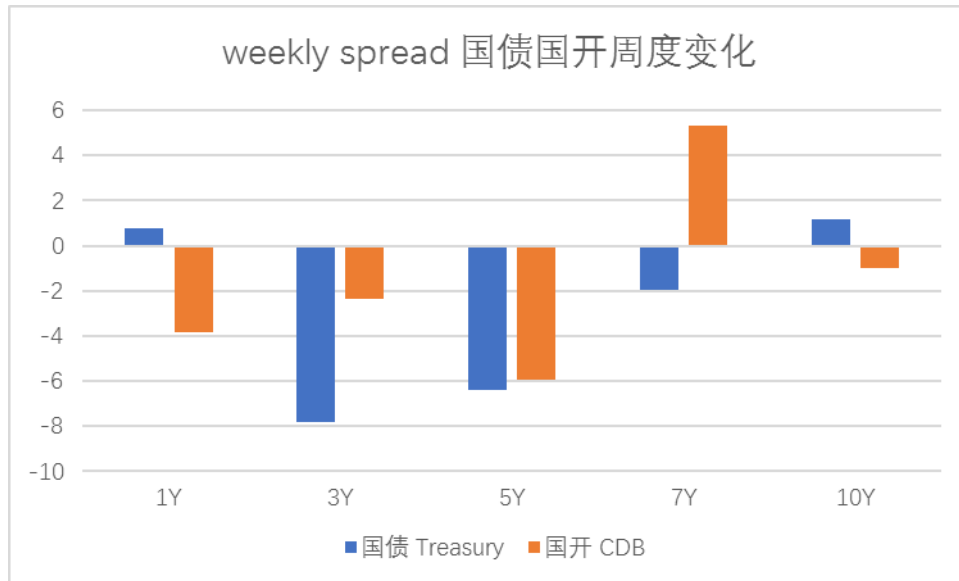
Shibor	利率	日变化 (bp)	周变化 (bp)	月变化 (bp)
1天	1.46	12	-59	-71
7天	2.16	3	-5	-6
14天	2.17	-0	-5	-14
1月	2.56	3	17	26
3月	2.70	0	4	10
6月	2.94	1	6	16

数据来源：Wind

债券

1. 现券周五尽管资金面尚可， 但出于对社融数据的不确定性， 市场日内小幅下跌， 尾盘社融数据总量超预期向好， 现券收益率继续下跌 2bp。 国债地方债 8 月发行量在历史上也属于高位， M2 增速降低 0.3%， 社融和 M2 正偏离， 表明银行间表内流动性偏弱。



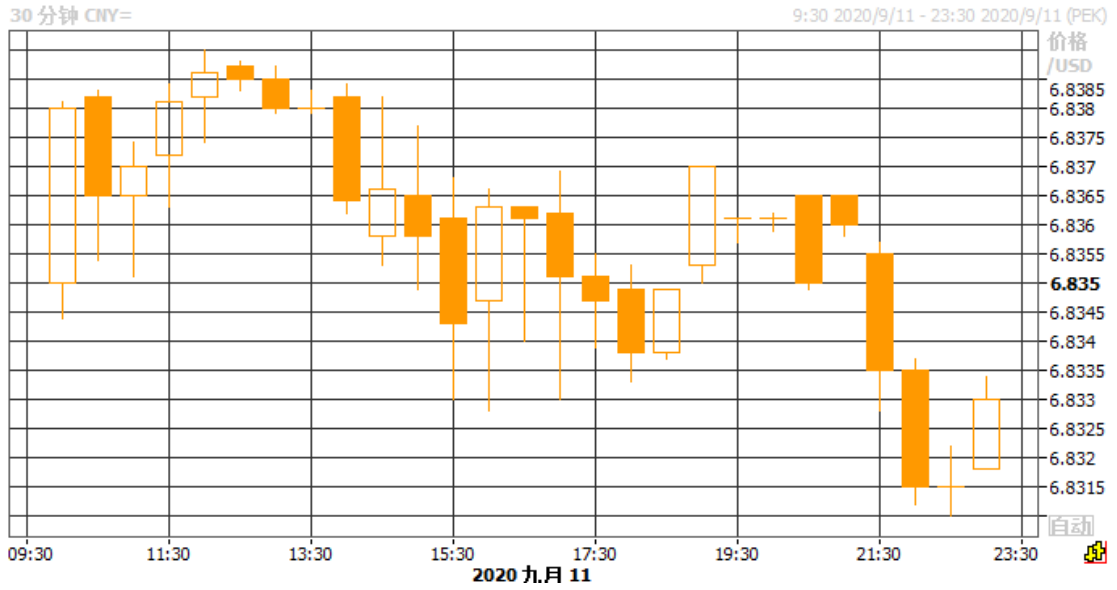


数据来源：Wind

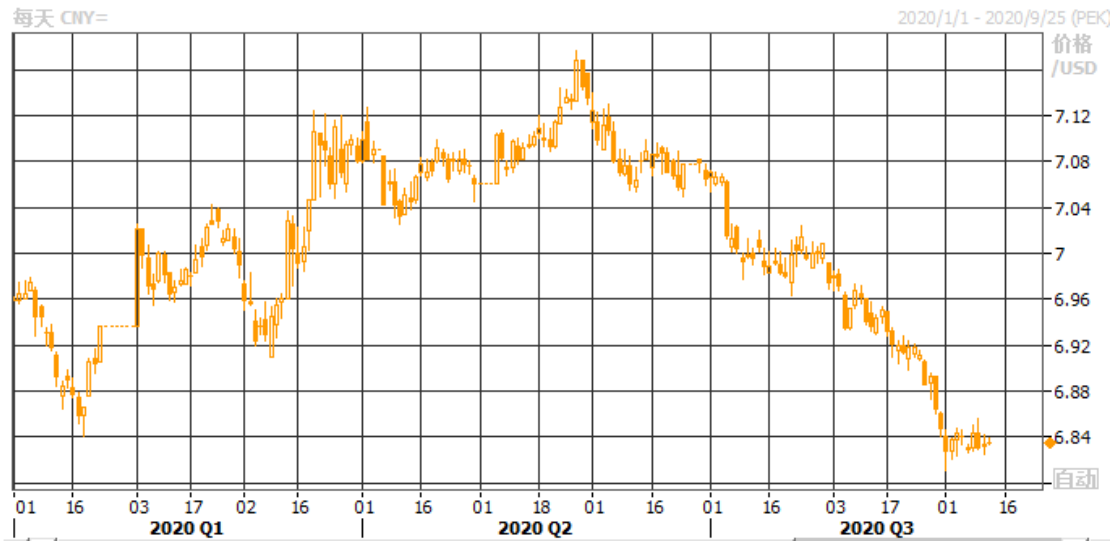
汇率

人民币兑美元即期周五收盘小升至 6.8369，日内成交量明显下滑，中间价则小跌至 6.8389；欧洲央行会议后美元持稳，且临近周末市场交投意愿不强，人民币反应也较为有限。市场已将目光转向美联储议息会议，短期缺乏关键信息指引，汇价料延续区间波动；而美联储仍可能维持偏宽松举措，美元继续存在下行压力，不过若美股再现异动，避险情绪料会暂时支撑美元。

美元兑人民币 2020 年 09 月 11 日间走势 Intraday USDCNY trend 2020/09/11



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