

市场流动性周报 (2022.08.08-2022.08.12)

公开市场操作:

- 8 月 8 日-8 月 12 日, 央行公开市场开展逆回购操作投放 100 亿元, 逆回购到期 100 亿元, 总体实现零净投放。本周预计将有 100 亿元逆回购到期, 6000 亿 MLF 到期。

货币市场:

- 截至 8 月 12 日, 银行间同业拆借加权平均利率较 8 月 5 日变动 2.41BP 至 1.15%, 质押式回购加权平均利率较 8 月 5 日变动 2.34BP 至 1.16%; 短期利率方面, 隔夜 shibor、1 周 shibor、2 周 shibor、1 个月 shibor 分别为 1.0440%、1.4130%、1.3490%、1.5130%, 较 8 月 5 日分别变动 2.50BP、2.90BP、-0.20BP、-8.10BP; 中期利率方面, 3 个月 shibor、6 个月 shibor、9 个月 shibor、1 年 shibor 分别为 1.6220%、1.7630%、1.8890%、1.9950%, 较 8 月 5 日分别变动 -7.70BP、-7.50BP、-6.10BP、-4.80BP。

国债市场:

- 截至 8 月 12 日, 1 个月期、3 个月期、6 个月期、1 年期、3 年期、5 年期、10 年期、30 年期国债到期收益率分别为 1.2003%、1.4508%、1.6614%、1.8115%、2.3358%、2.4892%、2.7347%、3.2422%, 较 8 月 5 日分别变动 7.37BP、3.39BP、11.41BP、9.99BP、6.58BP、2.35BP、0.08BP、1.03BP。

外汇市场:

- 截至 8 月 12 日, 美元兑人民币中间价较 8 月 5 日上行 8BP 至 6.7413; 美元兑人民币即期汇率较 8 月 5 日下行 158BP 至 6.7349, 较中间价低 64BP; 美元兑离岸人民币即期汇率较 8 月 5 日下行 290BP 至 6.7382, 较在岸即期汇率高 33BP。

分析师: 徐伟

资格证书: S1330514080001

联系邮箱: xuw@hxzb.cn

联系电话: 028-86199181

相关研究

一周市场回顾 (2022.08.08-2022.08.12)

2022.08.12

市场流动性周报 (2022.08.01-2022.08.05)

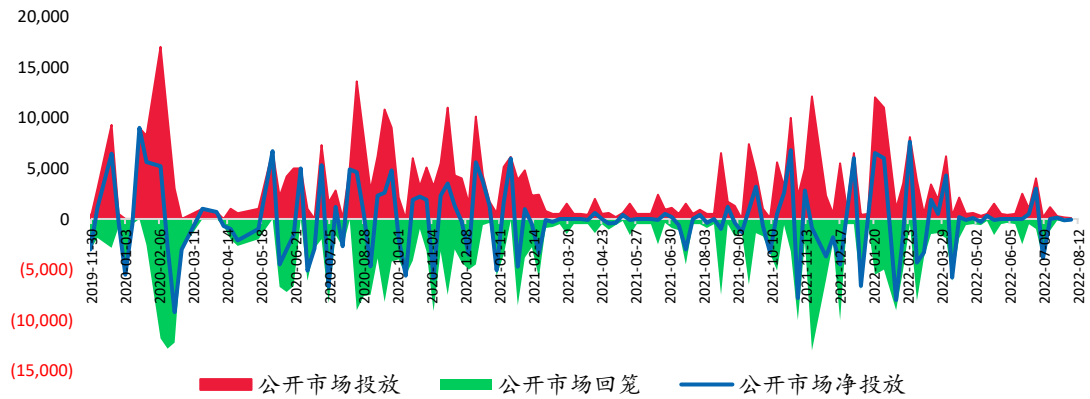
2022.08.08

一周市场回顾 (2022.08.01-2022.08.05)

2022.08.05

公开市场操作。8月8日-8月12日，央行公开市场开展逆回购操作投放100亿元，逆回购到期100亿元，总体实现零净投放。本周预计将有100亿元逆回购到期，6000亿MLF到期。

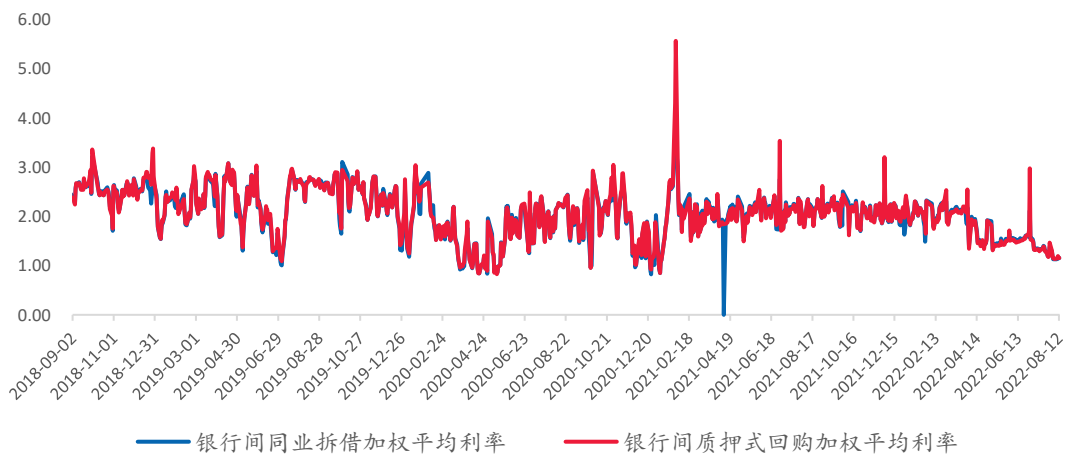
图 1：央行公开市场操作周度情况（亿元）



资料来源：Wind、央行网站、宏信证券研究发展部

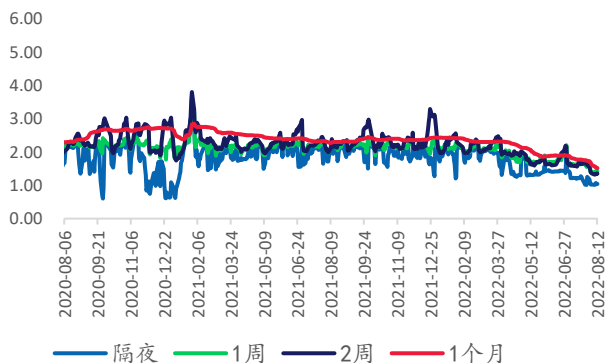
货币市场。截至8月12日，银行间同业拆借加权平均利率较8月5日变动2.41BP至1.15%，质押式回购加权平均利率较8月5日变动2.34BP至1.16%；**短期利率方面**，隔夜shibor、1周shibor、2周shibor、1个月shibor分别为1.0440%、1.4130%、1.3490%、1.5130%，较8月5日分别变动2.50BP、2.90BP、-0.20BP、-8.10BP；**中期利率方面**，3个月shibor、6个月shibor、9个月shibor、1年shibor分别为1.6220%、1.7630%、1.8890%、1.9950%，较8月5日分别变动-7.70BP、-7.50BP、-6.10BP、-4.80BP。

图 2：银行间加权平均利率走势（%）



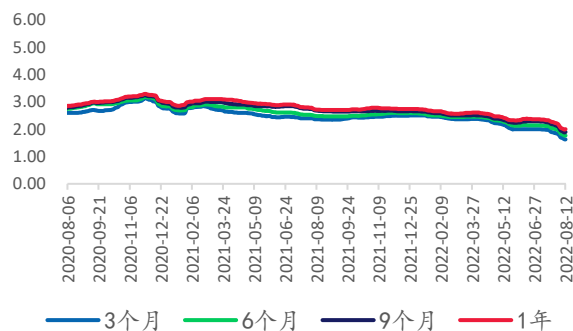
资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

图 3：短期 shibor 走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

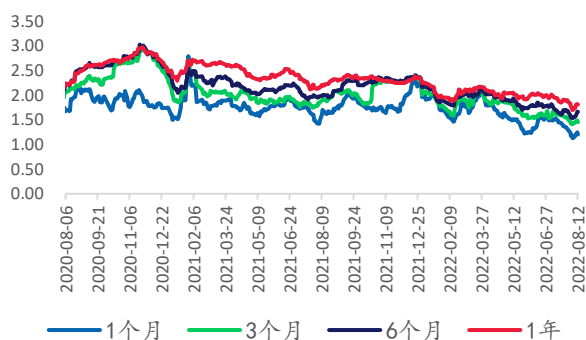
图 4：中期 shibor 走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

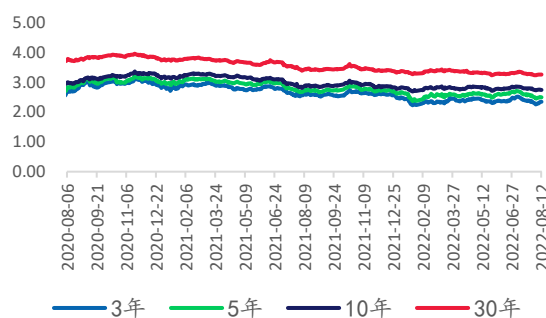
国债市场。截至8月12日，1个月期、3个月期、6个月期、1年期、3年期、5年期、10年期、30年期国债到期收益率分别为1.2003%、1.4508%、1.6614%、1.8115%、2.3358%、2.4892%、2.7347%、3.2422%，较8月5日分别变动7.37BP、3.39BP、11.41BP、9.99BP、6.58BP、2.35BP、0.08BP、1.03BP。

图 5：短期国债到期收益率走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

图 6：长期国债到期收益率走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

外汇市场。截至8月12日，美元兑人民币中间价较8月5日上行8BP至6.7413；美元兑人民币即期汇率较8月5日下行158BP至6.7349，较中间价低64BP；美元兑离岸人民币即期汇率较8月5日下行290BP至6.7382，较在岸即期汇率高33BP。

图 7：美元兑人民币中间价和即期汇率走势



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

预览已结束，完整报告链接和二维码如下：

https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1_45151

