

市场流动性周报 (2022.08.15-2022.08.19)

公开市场操作:

- 8 月 15 日-8 月 19 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, 同时 MLF 投放 4000 亿, MLF 到期 6000 亿; 总体实现净回笼 2000 亿。本周预计将有 100 亿元逆回购到期。

货币市场:

- 截至 8 月 19 日, 银行间同业拆借加权平均利率较 8 月 12 日变动 17.38BP 至 1.33%, 质押式回购加权平均利率较 8 月 12 日变动 16.53BP 至 1.32%; 短期利率方面, 隔夜 shibor、1 周 shibor、2 周 shibor、1 个月 shibor 分别为 1.2110%、1.5090%、1.4580%、1.4920%, 较 8 月 12 日分别变动 16.70BP、9.60BP、10.90BP、-2.10BP; 中期利率方面, 3 个月 shibor、6 个月 shibor、9 个月 shibor、1 年 shibor 分别为 1.5970%、1.7410%、1.8570%、1.9610%, 较 8 月 12 日分别变动-2.50BP、-2.20BP、-3.20BP、-3.40BP。

国债市场:

- 截至 8 月 19 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 1.2574%、1.4308%、1.5953%、1.7248%、2.2279%、2.3708%、2.5875%、3.1141%, 较 8 月 12 日分别变动 5.71BP、-2.00BP、-6.61BP、-8.67BP、-10.79BP、-11.84BP、-14.72BP、-12.81BP。

外汇市场:

- 截至 8 月 19 日, 美元兑人民币中间价较 8 月 12 日上行 652BP 至 6.8065; 美元兑人民币即期汇率较 8 月 12 日上行 739BP 至 6.8088, 较中间价高 23BP; 美元兑离岸人民币即期汇率较 8 月 12 日上行 982BP 至 6.8364, 较在岸即期汇率高 276BP。

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 (2022.08.15-2022.08.19)

2022.08.19

市场流动性周报 (2022.08.08-2022.08.12)

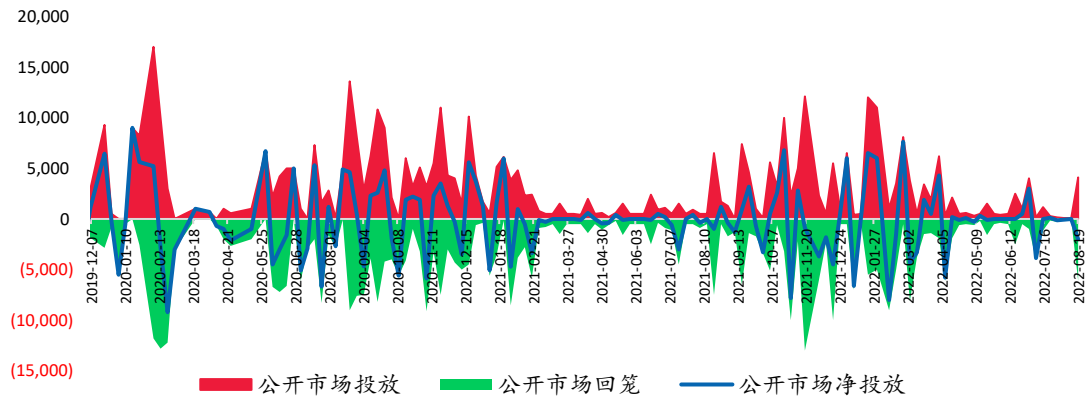
2022.08.15

一周市场回顾 (2022.08.08-2022.08.12)

2022.08.12

公开市场操作。8月15日-8月19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，同时MLF投放4000亿，MLF到期6000亿；总体实现净回笼2000亿。本周预计将有100亿元逆回购到期。

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

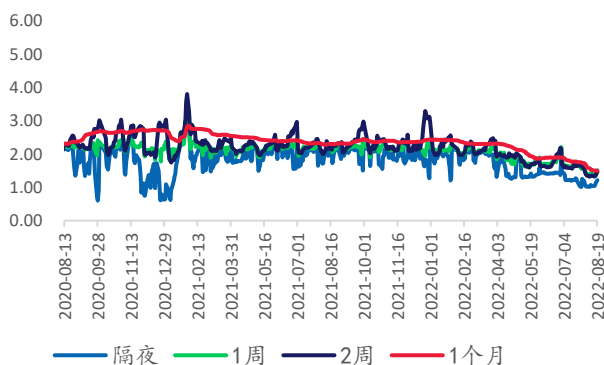
货币市场。截至8月19日，银行间同业拆借加权平均利率较8月12日变动17.38BP至1.33%，质押式回购加权平均利率较8月12日变动16.53BP至1.32%；**短期利率方面**，隔夜shibor、1周shibor、2周shibor、1个月shibor分别为1.2110%、1.5090%、1.4580%、1.4920%，较8月12日分别变动16.70BP、9.60BP、10.90BP、-2.10BP；**中期利率方面**，3个月shibor、6个月shibor、9个月shibor、1年shibor分别为1.5970%、1.7410%、1.8570%、1.9610%，较8月12日分别变动-2.50BP、-2.20BP、-3.20BP、-3.40BP。

图 2：银行间加权平均利率走势（%）



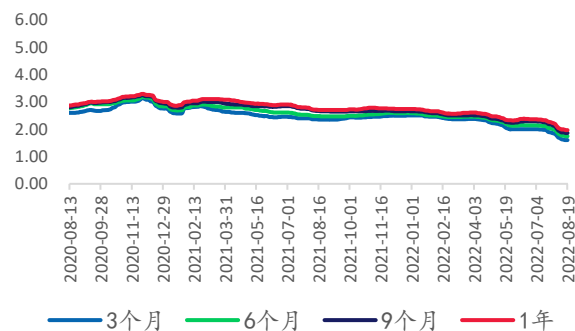
资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

图 3：短期 shibor 走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

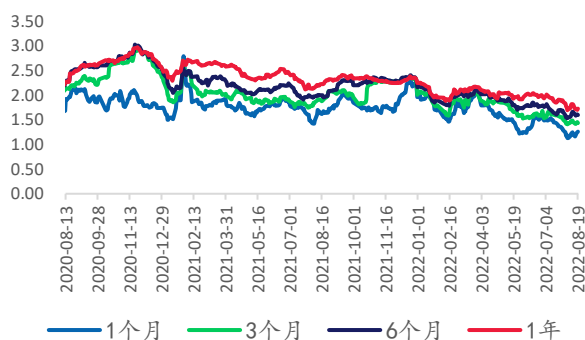
图 4：中期 shibor 走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

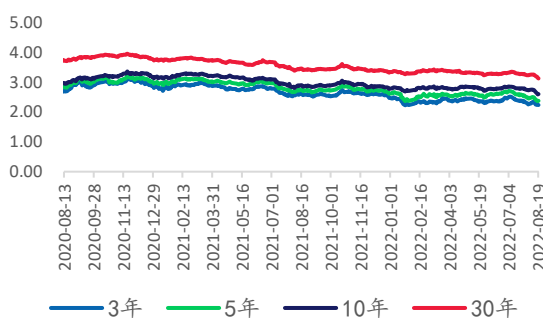
国债市场。截至8月19日，1个月期、3个月期、6个月期、1年期、3年期、5年期、10年期、30年期国债到期收益率分别为1.2574%、1.4308%、1.5953%、1.7248%、2.2279%、2.3708%、2.5875%、3.1141%，较8月12日分别变动5.71BP、-2.00BP、-6.61BP、-8.67BP、-10.79BP、-11.84BP、-14.72BP、-12.81BP。

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19日，美元兑人民币中间价较8月12日上行652BP至6.8065；美元兑人民币即期汇率较8月12日上行739BP至6.8088，较中间价高23BP；美元兑离岸人民币即期汇率较8月12日上行982BP至6.8364，较在岸即期汇率高276BP。

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_45461

