

市场流动性周报 (2022.08.01-2022.08.05)

公开市场操作:

- 8 月 1 日-8 月 5 日, 央行公开市场开展逆回购操作投放 100 亿元, 逆回购到期 160 亿元, 总体实现净回笼 60 亿。本周预计将有 100 亿元逆回购到期。

货币市场:

- 截至 8 月 5 日, 银行间同业拆借加权平均利率较 7 月 29 日变动-24.39BP 至 1.13%, 质押式回购加权平均利率较 7 月 29 日变动-33.49BP 至 1.13%; 短期利率方面, 隔夜 shibor、1 周 shibor、2 周 shibor、1 个月 shibor 分别为 1.0190%、1.3840%、1.3510%、1.5940%, 较 7 月 29 日分别变动-23.50BP、-32.10BP、-25.90BP、-14.30BP; 中期利率方面, 3 个月 shibor、6 个月 shibor、9 个月 shibor、1 年 shibor 分别为 1.6990%、1.8380%、1.9500%、2.0430%, 较 7 月 29 日分别变动-14.70BP、-15.80BP、-18.10BP、-17.50BP。

国债市场:

- 截至 8 月 5 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 1.1266%、1.4169%、1.5473%、1.7116%、2.2700%、2.4657%、2.7339%、3.2319%, 较 7 月 29 日分别变动-15.94BP、-8.19BP、-10.89BP、-15.07BP、-5.28BP、-4.79BP、-2.21BP、-1.30BP。

外汇市场:

- 截至 8 月 5 日, 美元兑人民币中间价较 7 月 29 日下行 32BP 至 6.7405; 美元兑人民币即期汇率较 7 月 29 日上行 117BP 至 6.7507, 较中间价高 102BP; 美元兑离岸人民币即期汇率较 7 月 29 日上行 142BP 至 6.7672, 较在岸即期汇率高 165BP。

分析师: 徐伟

资格证书: S1330514080001

联系邮箱: xuwx@hxzb.cn

联系电话: 028-86199181

相关研究

一周市场回顾 (2022.08.01-2022.08.05)

2022.08.05

市场流动性周报 (2022.07.25-2022.07.29)

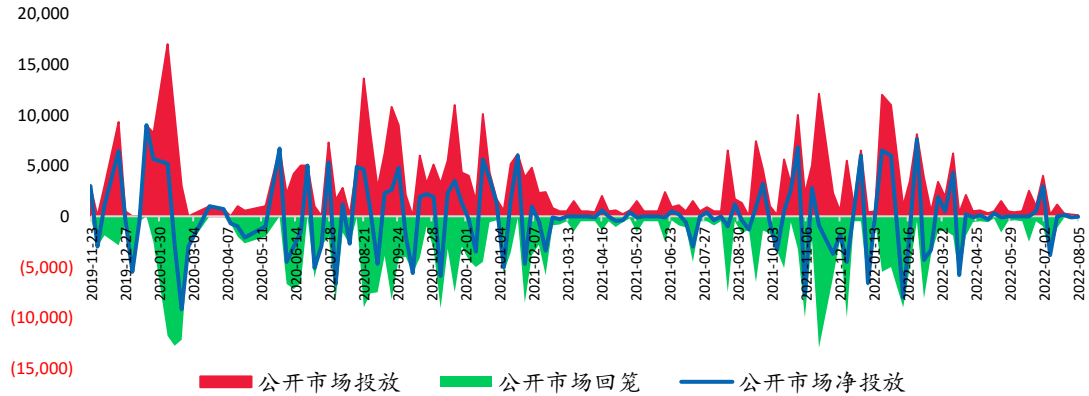
2022.08.01

一周市场回顾 (2022.07.25-2022.07.29)

2022.07.29

公开市场操作。8月1日-8月5日,央行公开市场开展逆回购操作投放100亿元,逆回购到期160亿元,总体实现净回笼60亿。本周预计将有100亿元逆回购到期。

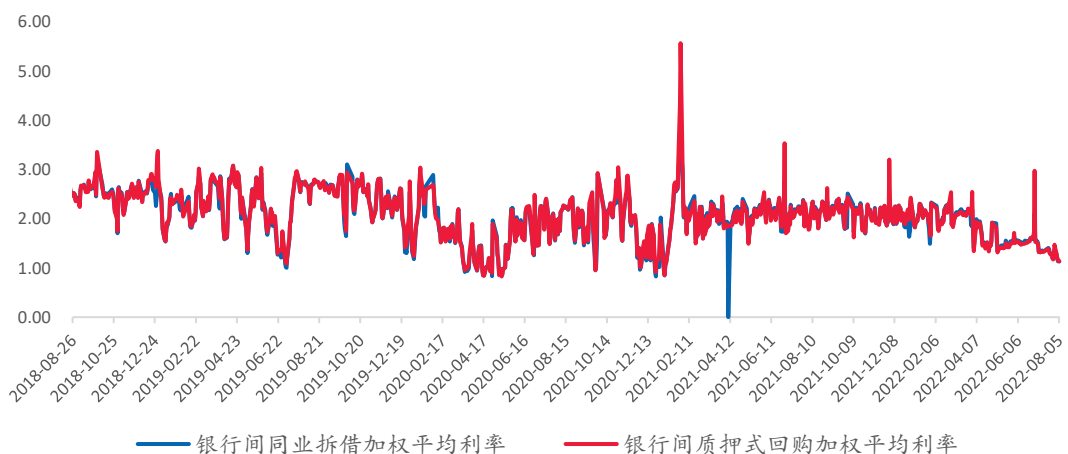
图 1: 央行公开市场操作周度情况 (亿元)



资料来源: Wind、央行网站、宏信证券研究发展部

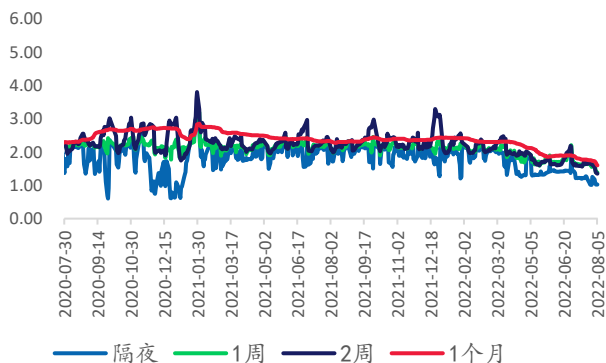
货币市场。截至8月5日,银行间同业拆借加权平均利率较7月29日变动-24.39BP至1.13%,质押式回购加权平均利率较7月29日变动-33.49BP至1.13%;**短期利率方面**,隔夜shibor、1周shibor、2周shibor、1个月shibor分别为1.0190%、1.3840%、1.3510%、1.5940%,较7月29日分别变动-23.50BP、-32.10BP、-25.90BP、-14.30BP;**中期利率方面**,3个月shibor、6个月shibor、9个月shibor、1年shibor分别为1.6990%、1.8380%、1.9500%、2.0430%,较7月29日分别变动-14.70BP、-15.80BP、-18.10BP、-17.50BP。

图 2: 银行间加权平均利率走势 (%)



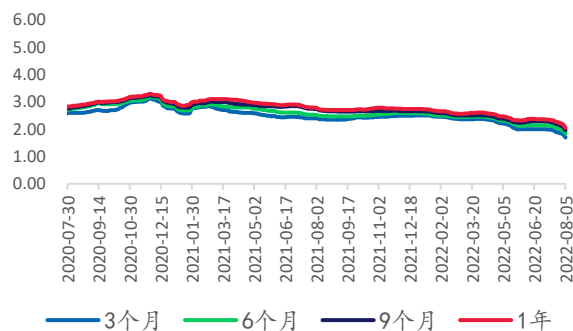
资料来源: Wind、宏信证券研究发展部

图 3：短期 shibor 走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

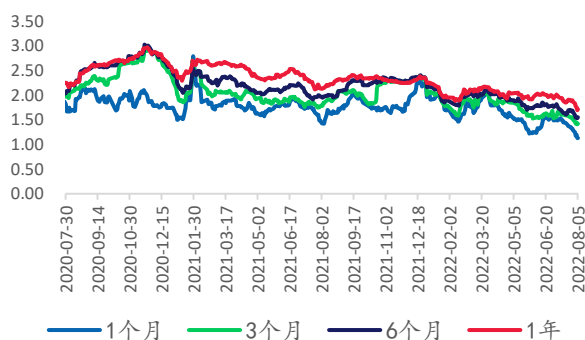
图 4：中期 shibor 走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

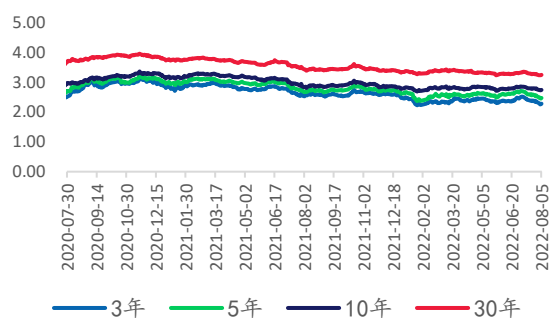
国债市场。截至 8 月 5 日，1 个月期、3 个月期、6 个月期、1 年期、3 年期、5 年期、10 年期、30 年期国债到期收益率分别为 1.1266%、1.4169%、1.5473%、1.7116%、2.2700%、2.4657%、2.7339%、3.2319%，较 7 月 29 日分别变动-15.94BP、-8.19BP、-10.89BP、-15.07BP、-5.28BP、-4.79BP、-2.21BP、-1.30BP。

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 5 日，美元兑人民币中间价较 7 月 29 日下行 32BP 至 6.7405；美元兑人民币即期汇率较 7 月 29 日上行 117BP 至 6.7507，较中间价高 102BP；美元兑离岸人民币即期汇率较 7 月 29 日上行 142BP 至 6.7672，较在岸即期汇率高 165BP。

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_44855

