

市场流动性周报 (2022.09.05-2022.09.09)

公开市场操作:

- 9 月 5 日-9 月 9 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 9 月 9 日, 银行间同业拆借加权平均利率较 9 月 2 日变动 0.24BP 至 1.28%, 质押式回购加权平均利率较 9 月 2 日变动 0.10BP 至 1.29%; 短期利率方面, 隔夜 shibor、1 周 shibor、2 周 shibor、1 个月 shibor 分别为 1.1730%、1.4760%、1.4090%、1.5030%, 较 9 月 2 日分别变动-0.20BP、-3.40BP、-1.90BP、0.30BP; 中期利率方面, 3 个月 shibor、6 个月 shibor、9 个月 shibor、1 年 shibor 分别为 1.6000%、1.7500%、1.8700%、1.9690%, 较 9 月 2 日分别变动 0.00BP、0.00BP、0.00BP、-0.10BP。

国债市场:

- 截至 9 月 9 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 1.1501%、1.4613%、1.6574%、1.7597%、2.1779%、2.4184%、2.6350%、3.0982%, 较 9 月 2 日分别变动-0.06BP、1.97BP、-0.80BP、4.04BP、-0.51BP、1.60BP、1.24BP、-0.26BP。

外汇市场:

- 截至 9 月 9 日, 美元兑人民币中间价较 9 月 2 日上行 181BP 至 6.9098; 美元兑人民币即期汇率较 9 月 2 日上行 164BP 至 6.9192, 较中间价高 94BP; 美元兑离岸人民币即期汇率较 9 月 2 日上行 185BP 至 6.9371, 较在岸即期汇率高 179BP。

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 (2022.09.05-2022.09.09)

2022.09.09

市场流动性周报 (2022.08.29-2022.09.02)

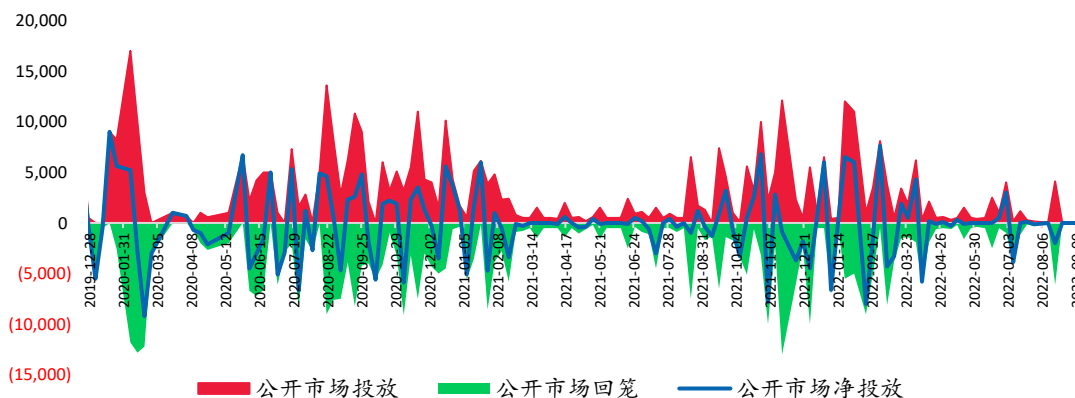
2022.09.05

一周市场回顾 (2022.08.29-2022.09.02)

2022.09.02

公开市场操作。9月5日-9月9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。

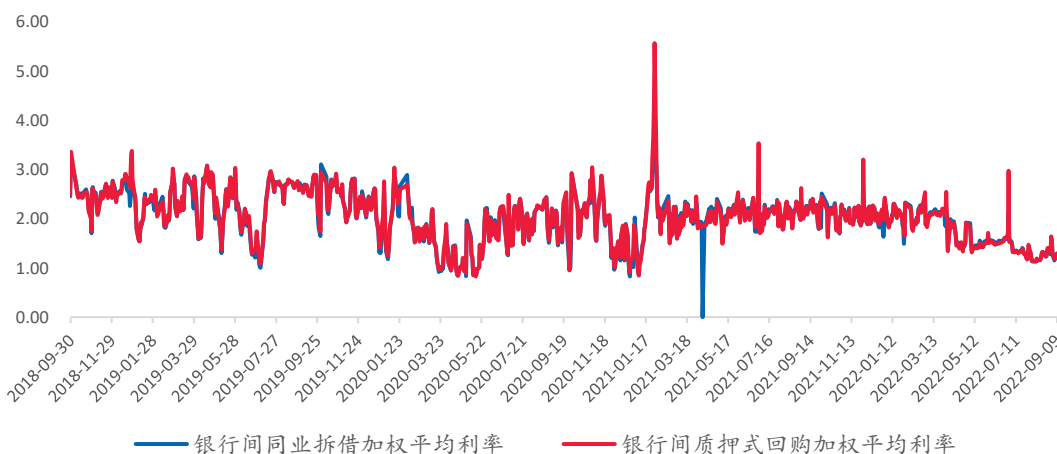
图 1: 央行公开市场操作周度情况 (亿元)



资料来源: Wind、央行网站、宏信证券研究发展部

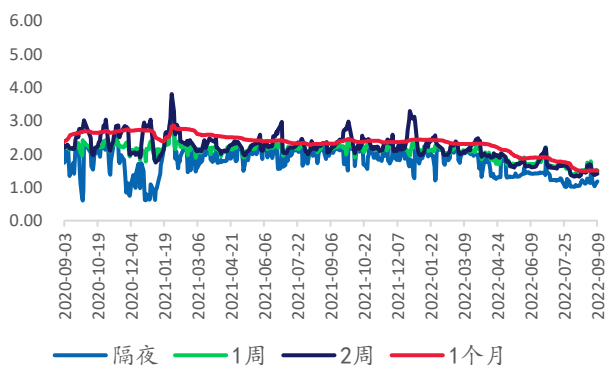
货币市场。截至9月9日,银行间同业拆借加权平均利率较9月2日变动0.24BP至1.28%,质押式回购加权平均利率较9月2日变动0.10BP至1.29%;**短期利率方面**,隔夜shibor、1周shibor、2周shibor、1个月shibor分别为1.1730%、1.4760%、1.4090%、1.5030%,较9月2日分别变动-0.20BP、-3.40BP、-1.90BP、0.30BP;**中期利率方面**,3个月shibor、6个月shibor、9个月shibor、1年shibor分别为1.6000%、1.7500%、1.8700%、1.9690%,较9月2日分别变动0.00BP、0.00BP、0.00BP、-0.10BP。

图 2: 银行间加权平均利率走势 (%)



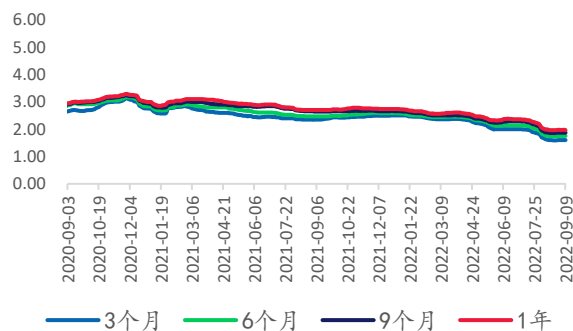
资料来源: Wind、宏信证券研究发展部

图 3：短期 shibor 走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

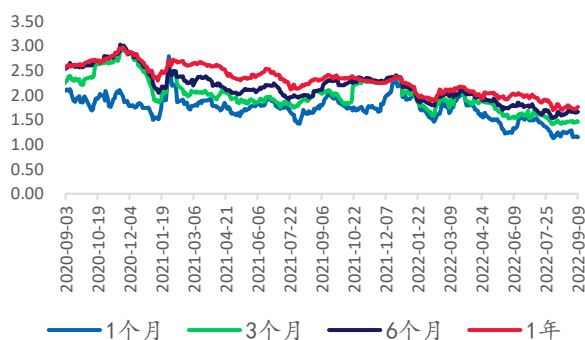
图 4：中期 shibor 走势 (%)



资料来源：Wind、宏信证券研究发展部

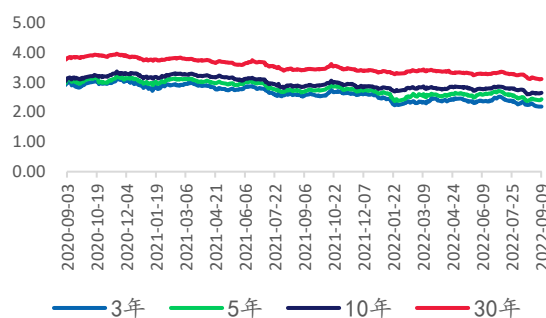
国债市场。截至9月9日，1个月期、3个月期、6个月期、1年期、3年期、5年期、10年期、30年期国债到期收益率分别为1.1501%、1.4613%、1.6574%、1.7597%、2.1779%、2.4184%、2.6350%、3.0982%，较9月2日分别变动-0.06BP、1.97BP、-0.80BP、4.04BP、-0.51BP、1.60BP、1.24BP、-0.26BP。

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9月9日，美元兑人民币中间价较9月2日上行181BP至6.9098；美元兑人民币即期汇率较9月2日上行164BP至6.9192，较中间价高94BP；美元兑离岸人民币即期汇率较9月2日上行185BP至6.9371，较在岸即期汇率高179BP。

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_46043

