



【2022-12-06】

人民币回购及NCD

货币市场

周二，质押式回购存款类机构加权价格如下：

交易品种	DR001	DR007	DR014	DR021	DR1M	DR2M	DR3M	DR1Y
加权利率 (%)	1.0256	1.6032	1.5999	1.5383	2.0591	2.2000	2.2000	2.7000
涨跌幅 (BP)	-4.58	0.23	2.14	-2.24	3.76	0.00	-10.00	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.0430	1.6770	1.6500	1.9350	2.2070	2.3350	2.3900	2.4650
涨跌幅 (BP)	-3.70	-1.20	3.10	0.60	0.60	0.80	0.60	0.50

【公开市场操作】央行开展了 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%。今日 800 亿元逆回购到期，因此当日净回笼 780 亿元。

今日资金面整体均衡偏松。早盘大行国股有融出。隔夜押利率加权至+10bps 融出，押存单信用加权+30bps 至+35bps 或 1.65%至 1.80%融出。7 天押利率加权或 1.65%融出，押存单、信用 1.70%至 1.90%融出。14 天押利率加权融出，押存单、信用 1.95%至 2.00%融出。1M 押存单、信用 2.60%融出。午后融出报价减少，资金面略有收敛，临近尾盘有减点隔夜融出，总体呈均衡态势至收盘。

资金面情绪指数：46-47-49-45

存单市场

截至下午 5 点 30 分，12 月 6 日有 114 只同业存单发行，实际发行量 644.5 亿，12 月 7 日将有 128 只存单计划发行，计划发行量为 1204.8 亿。

一级存单方面：今日一级存单除 1M 外，其余期限为工作日到期，其中 3M 和 6M 交投情绪相对较好。具体来看，1M （休一）大行在 1.90%有成交，AAA 城农商行询在 1.90%至 2.20%，需求寥寥；3M 部分国股在 2.30%位置供不应求，AAA 大城商在 2.33%、其他部分城商在 2.35%-2.38%有少量成交；6M 大行在 2.40%位置有部分需求，AAA 城农商在 2.49%-2.50%位置交投活跃，多家提前募满截单；9M 交投清淡，大行国股询在 2.45%，AAA 城农商行询在 2.40%至 2.60%；1Y 个别大行在 2.51%位置需求较好，部分国股尾盘有 2.52%的发行成交，AAA 城农商行询在 2.40%至 2.61%，需求清淡。(Coco Gao)

附：国股/大行 NCD 一级询价利率

国股/大行存单	1M	3M	6M	9M	1Y
昨日询价最高利率 (%)	1.85	2.23	2.38	2.40	2.50
今日询价最高利率 (%)	1.85	2.30	2.40	2.45	2.51
涨跌幅 (BP)	0	7	2	5	1

二级存单交易方面：早盘 3M-6M 期限成交收益率小幅上行，9M-1Y 期限成交收益率较昨日基本持平，下午各期限成交收益率有明显上行趋势。

具体来看：12 月到期，国股大行成交在 1.38%-1.45%，AAA 大城农商成交在 1.45%-1.50%；明年 1 月到期，国股大行成交在 2.13%-2.25%，AAA 大城农商成交在 2.20%-2.24%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.20%-2.32%，AAA 大城农商成交在 2.34%-2.36%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.35%-2.40%，AAA 大城农商成交在 2.40%-2.45%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.39%-2.42%，AAA 大城农商少量成交在 2.45%-2.50%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.48%-2.54%，AAA 大城农商成交在 2.50%-2.58%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.49%-2.54%，AAA 大城农商少量成交在 2.54%-2.58%；明年 10-12 月到期，国股大行成交在 2.50%-2.55，AAA 大城农商成交在 2.54%-2.58%。(Honghe Meng)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率（%）	AAA (国股)	2.20	2.32	2.46	2.55	2.55
	AAA (非国股)	2.25	2.35	2.49	2.58	2.58
与昨日收益变动对照（BP）	AAA (国股)	8	5	6	5	4
	AAA (非国股)	8	5	7	3	0

外币拆借市场

境内美元拆借市场：今日境内美金市场流动性隔夜期限较松，其他期限均衡，成交集中在 O/N-1M 短期限，中长期限交投清淡。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.78%-3.82%，成交集中在 3.79%-3.82%；1W 市场买盘报在 3.84%-4.00%，成交集中在 3.90%-4.00%；2W 市场少量买盘报在 4.00%-4.08%，成交在 4.08%；1M 市场买盘报在 4.20%-4.50%，部分成交在 4.38%-4.50%；2M 市场少量买盘报 4.70%-4.90%，卖盘稀缺；3M 市场买盘报 5.17%-5.60%，少量交投在 5.60%；6M 市场少量买盘报 5.32%-5.75%、9M 市场少量买盘报 5.47%，1Y 市场少量买盘在 5.59%-5.80%，成交寥寥。

境内美金回购市场：今日境内美金回购市场流动性较松，少量交投在隔夜短期限，有 O/N 成交在 3.82%。

境内美金存单市场：今日境内美金存单市场交投清淡，市场各期限询价情绪较冷清。

境外美元拆借市场：今日境外美金市场流动性整体均衡偏松，成交集中在 O/N-1W，1M 和 3M 期限有部分交投。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.75%-3.82%，成交在 3.76%-3.82%；1W 市场双边交投在 3.85%-3.92%；2W 市场少量买盘报 4.08%，成交寥寥；1M 市场买盘报 4.48%-4.70%，部分成交在 4.65%-4.68%；2M 市场双边报价稀缺；3M 市场少量买盘集中报在 5.35%-5.50%，成交在 5.50%；长期限市场，6M 少量买盘报在 5.70%、9M 暂无买盘报价，1Y 少量买盘报在 5.65%，暂无交投。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	3.80	3.82
1W	3.90	3.95
1M	4.30	4.40
3M	5.40	5.50
6M	5.50	5.60
1Y	5.60	5.70

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	3.95	4.70	5.45	5.75	5.80
GBP	3.02	3.27	4.35	4.81	5.06
EUR	1.51	1.50	2.63	3.08	3.27
AUD	2.95	3.02	3.81	4.08	4.39
YEN	0.03	-0.51	0.59	0.69	0.60
CNH	1.20	1.85	2.25	2.85	3.15
HKD	4.25	5.25	5.70	5.80	5.85

同业存放和非银存款参考报价

2022/12/06 放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.85	1.63~ 1.1
2w	2.2 ~ 2.1	1.63 ~ 1.1
1m	2.5 ~ 2.2	2.15 ~ 1.8
3m	2.73 ~ 2.5	2.4~ 1.7
6m	2.92 ~ 2.6	2.5 ~ 2.0
1y	3.01 ~ 2.66	2.55~ 2.2

2022/12/06 金存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	3.75 ~ 3.55	L-10 ~ L-10
2w	3.95 ~ 3.75	L-10 ~ L-10
1m	4.05 ~ 3.95	L+10 ~ L-10
3m	4.45 ~ 4.25	L+10 ~ L-15
6m	4.75 ~ 4.45	L+0 ~ L-15
1y	5.15 ~ 4.9	L+20 ~ L-10

2022/12/06 银存款各期限双边价格

期限	融出	融入
1m	3.95 ~ 3.65	3.55 ~ 2.75
3m	4.1 ~ 3.8	3.75 ~ 3.15
6m	4.4 ~ 4.25	4.15 ~ 3.4
1y	4.6 ~ 4.3	4.2 ~ 3.6
1/2Y	/	/
5Y	/	/

2022/12/06 银存款美金各期限双边价格

期限	融出	融入
1W	/	/
2W	/	/
1m	4.9 ~ 4.65	4.55 ~ 4.35
3m	5.25 ~ 4.95	4.85 ~ 4.55
6m	5.35 ~ 5.15	5.1 ~ 4.85
1y	5.75 ~ 5.4	5.35 ~ 5.15

文 /Coco Gao, Honghe Meng, Allen Huang, Zhanglan Yang

联系人: Rachael Yoo
邮箱: rachael.yoo@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改，所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN