



【2022-12-07】

人民币回购及NCD

货币市场

周三，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	DR4M
加权利率 (%)	1.0133	1.6363	1.5424	1.5292	2.2041	2.2960	2.3000	2.5000
涨跌幅 (BP)	-1.23	3.31	-5.75	-0.91	14.50	9.60	10.00	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.0070	1.6630	1.5810	1.9520	2.2310	2.3530	2.4050	2.4760
涨跌幅 (BP)	-3.60	-1.40	-6.90	1.70	2.40	1.80	1.50	1.10

【公开市场操作】央行公开市场开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%。今日 1700 亿元逆回购到期。

今日早盘资金面均衡，国股大行有部分融出。隔夜押利率加权+10bps（限银行）至 1.50%融出，押存单信用加权+15bps（限银行）至+20bps 不低 1.70%融出；7 天押利率加权至 1.65%融出，押存单信用 1.70%不低于加权至 1.90%融出；14 天至 1M 融出较少，成交寥寥。午盘资金面收敛，大行股份制暂未出头寸，隔夜、7 天融出减少，直至收盘，资金面仍呈均衡收敛态势。

今日全天的资金面情绪指数：48-49-51-49

存单市场

截至下午 5 点 30 分，12 月 7 日有 114 只同业存单发行，实际发行量 1009.7 亿，12 月 8 日将有 113 只存单计划发行，计划发行量为 809 亿。

一级存单方面：一级存单方面，今日 1M、3M、6M 为工作日到期，9M、1Y 为休息日到期。今日整体成交较为清淡，上午 1M、3M 期限交投活跃。具体来看，1M 国股大行询在 1.90%-2.00%，大行在 2.00%位置募满，AAA 城农商询在 2.30%-2.40%，好名字城商行在 2.40%位置获得较好需求，迅速募满；3M 国股大行询在 2.25%-2.30%，AAA 城农商询在 2.32%-2.50%，部分城商行在 2.40%-2.42%位置募满；6M 国股大行询在 2.40%-2.45%，AAA 城农商询在 2.40%-2.60%，部分城农商在 2.53%-2.55%位置获得需求，有一定成交；9M（休二）国股询在 2.40%，AAA 城农商询在 2.40%-2.70%，有农商行在 2.65%募满；1Y（休二）国股大行询在 2.45%，AAA 城农商询在 2.40%-2.72%。(Bella Wang)

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	2.30	2.40	2.45	2.51
今日询价最高利率 (%)	2.00	2.30	2.45	2.40	2.45
涨跌幅 (BP)	15	0	5	-5	-6

二级存单交易方面：月内成交收益率较昨日基本持平，跨年期限成交收益率呈先上后下趋势，尾盘成交收益率较昨日小幅上行。

具体来看：12 月到期，国股大行成交在 1.35%-1.40%，AAA 大城农商成交在 1.41%-1.45%；明年 1 月到期，国股大行成交在 2.15%-2.27%，AAA 大城农商成交在 2.26%-2.30%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.32%-2.40%，AAA 大城农商成交在 2.35%-2.42%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.45%-2.48%，AAA 大城农商成交在 2.47%-2.50%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.45%-2.50%，AAA 大城农商少量成交在 2.48%-2.52%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.55%-2.58%，AAA 大城农商成交在 2.58%-2.62%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.57%-2.60%，AAA 大城农商少量成交在 2.63%-2.65%；明年 10-12 月到期，国股大行早盘成交在 2.58%-2.59%，随后呈先上后下趋势，最高成交在 2.60%附近，尾盘成交在 2.57%-2.58%附近，AAA 大城农商少量成交在 2.64%-2.65%。(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	2.35	2.47	2.56	2.57
	AAA (非国股)	2.25	2.38	2.50	2.59	2.63
与昨日收益变动对照（BP）	AAA (国股)	0	3	1	1	2
	AAA (非国股)	0	3	1	1	5

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宽松，其他期限均衡微紧，成交集中在 O/N-1W 短期限，1M 期限有部分成交，更长期限交投清淡。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.78%-3.82%，区间内均有成交；1W 市场买盘报在 3.85%-4.00%，区间内均有成交；2W 市场双边交投清淡；1M 市场买盘活跃，报在 4.20%-4.70%，部分成交在 4.45%-4.70%；2M 市场少量买盘报 4.70%-4.90%，卖盘稀缺；3M 市场买盘报 5.19%-5.50%、6M 市场少量买盘报 5.36%-5.75%、9M 市场少量买盘报 5.48%，1Y 市场少量买盘在 5.60%-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宽松，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短期限较松，中长期期限均衡偏紧，成交集中在 O/N-1W 期限，1M 期限有部分交投。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.76%-3.82%，区间内有成交；1W 市场买盘报在 3.83%-3.95%，部分成交在 3.85%-3.95%；2W 市场少量买盘报 4.00%-4.08%，成交寥寥；1M 市场买盘积极，报在 4.45%-4.65%，部分成交在 4.55%-4.65%；2M 市场少量买盘在 4.90%、3M 市场少量买盘报在 5.35%-5.42%，均无成交；长期限市场，6M 少量买盘报在 5.65%-5.70%、9M 暂无买盘报价，1Y 少量买盘报在 5.65%-5.70%，暂无成交。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	3.78	3.82
1W	3.90	3.95
1M	4.35	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	3.05	3.30	4.35	4.80	5.08
EUR	1.50	1.52	2.63	3.10	3.26
AUD	2.96	3.06	3.80	4.08	4.40
YEN	-0.02	-0.39	0.48	0.59	0.53
CNH	1.10	1.75	2.60	2.85	3.15
HKD	4.10	5.25	5.70	5.80	5.85

同业存放和非银存款参考报价

2022/12/07 放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.85	1.5~ 1.1
2w	2.2 ~ 2.1	1.5 ~ 1.1
1m	2.5 ~ 2.2	2.15 ~ 1.8
3m	2.73 ~ 2.5	2.42~ 1.7
6m	2.92 ~ 2.6	2.52 ~ 2.0
1y	3.01 ~ 2.66	2.55~ 2.2

2022/12/07 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

2022/12/07 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	/	/

2022/12/07 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 / Bella Wang, 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:

以上所念及附加的所有信息 (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、时效性或准确性等需求。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