

收盘日评 银行间货币市场

常规报告系列

15th
CFETS-NEX
上海国际货币经纪15周年
CFETS-NEX 15th Anniversary 2007-2022

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2022-12-08】

人民币回购及NCD

货币市场

周四，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	DR6M
加权利率 (%)	1.0712	1.6609	1.6460	1.5463	2.1817	2.3300	2.3500	2.5000	2.5000
涨跌幅 (BP)	5.79	2.46	10.36	1.71	-2.24	3.40	5.00	0.00	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.0640	1.7100	1.6370	1.9670	2.2500	2.3695	2.4190	2.4880
涨跌幅 (BP)	5.70	4.70	5.60	1.50	1.90	1.65	1.40	1.20

【公开市场操作】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，12月8日以利率招标方式开展了20亿元7天期逆回购操作，中标利率2.0%。Wind数据显示，今日100亿元逆回购到期，因此当日净回笼80亿元。

今日资金面整体均衡。早盘资金面均衡，大行国股有部分融出，隔夜押利率加权融出，押存单1.65%至1.70%融出，押信用1.80%至1.90%融出。7天押利率1.65%至加权融出，押存单1.75%至1.85%融出，押信用1.95%至2.00%融出。14天押利率1.70%至加权融出，押存单、信用2.10%至2.20%融出。21天至1M融出较少，1M跨月押利率2.15%至加权融出，押存单、信用2.70%至2.80%融出，成交寥寥。资金面维持均衡态势至午间收盘。午后资金面延续均衡态势，资金价格较上午小幅下降，隔夜押存单、信用1.60%至1.70%融出。总体呈均衡偏松态势直至收盘。

今日全天的资金面指数：50-52-53-47

☒

存单市场

截至下午5点30分，12月8日有96只同业存单发行，实际发行量664.2亿，12月9日将有123只存单计划发行，计划发行量为882.9亿。

一级存单方面：今日3M为休息日到期，其余期限为工作日到期，整体交投较清淡，1M和6M城农商行相对较活跃。具体来看，1M国股大行询在1.90%至2.00%，个别国股在1.95%位置募满，AAA城农商行询在2.05%至2.48%，大城商提价至2.45%后需求较好；3M国股询在2.25%，AAA城农商行询在2.35%至2.50%；6M国股大行询在2.45%至2.48%，AAA城农商行询在2.40%至2.60%，部分城农商行在2.55%-2.56%位置有少量需求，个别在2.60%位置募满截单；9M国股大行询在2.40%至2.58%，个别国股在2.58%位置有少量成交，AAA城农商行询在2.40%至2.70%，有大城商行在2.65%位置迅速募满截单；1Y国股大行询在2.45%至2.60%，下午部分国股提价至2.60%后募集部分需求，AAA城农商行询在2.40%至2.75%，有大城商行在2.67%位置募集较好。(Anqi Zhang)

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 (%)	2.00	2.30	2.45	2.40	2.45
今日询价最高利率 (%)	1.95	2.25	2.48	2.56	2.60
涨跌幅 (BP)	-5	-5	3	16	15

二级存单交易方面：月内成交收益率较昨日基本持平，6M-1Y期限成交收益率呈上行趋势。

具体来看：12月到期，国股大行成交在1.30%-1.40%，AAA大城农商成交在1.35%-1.45%；明年1月到期，国股大行春节前成交在2.17%-2.22%，AAA大城农商成交寥寥；明年2-3月到期，国股大行成交在2.33%-2.37%，AAA大城农商成交在2.35%-2.45%；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2.50%-2.54%；明年5-6月到期，国股大行成交在2.46%-2.50%，AAA大城农商少量成交在2.50%-2.52%；明年7-8月到期，国股大行成交在2.55%-2.60%，AAA大城农商成交在2.63%-2.70%；明年9月到期，国股大行成交在2.57%-2.605%，AAA大城农商少量成交在2.60%-2.66%；明年10-12月到期，国股大行早盘成交在2.58%-2.59%，随后呈上行趋势，尾盘成交在2.60%-2.615%附近，AAA大城农商少量成交在2.65%-2.66%。(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)	2.22	2.35	2.50	2.60	2.61
	AAA (非国股)	2.25	2.38	2.53	2.65	2.66
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	2	0	3	4	4
	AAA (非国股)	0	0	3	6	3

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，成交集中在O/N期限，1M期限有部分成交，中长期限交投寥寥。具体来看：O/N市场买盘报在3.79%-3.82%，区间内均有成交；1W市场买盘报在3.85%-4.00%，成交稀缺；2W市场少量买盘报在4.00附近；1M市场买盘活跃，报在4.35%-4.60%，部分成交在4.45%；2M市场少量买盘报4.70%-4.90%，卖盘寥寥；3M市场买盘报5.20%-5.50%，部分卖盘报5.60%附近；6M市场少量买盘报5.37%、9M市场少量买盘报5.49%，1Y市场少量买盘在5.61%-5.80%，暂无成交。

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宽松, 中长期均衡, 成交集中在 O/N-1W 期限, 1M、3M 和 1Y 期限有少量交投。具体来看, O/N 市场买盘报在 3.75%-3.80%, 区间内有成交; 1W 市场买盘报在 3.77%-3.95%, 部分成交在 3.90%; 2W 市场少量买盘报 4.00%-4.10%, 成交寥寥; 1M 市场买盘积极, 报在 4.45%-4.60%, 少量成交在 4.60%; 2M 市场双边报价稀缺; 3M 市场少量买盘报在 5.30%-5.40%, 成交在 5.30%; 长期市场, 6M 少量买盘报在 5.65%-5.70%、9M 少量买盘报在 5.73%, 1Y 少量买盘报在 5.65%-5.73%, 成交在 5.65%。(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	3.93	4.65	5.50	5.71	5.75
GBP	3.01	3.28	4.45	4.82	5.04
EUR	1.18	1.48	2.71	3.07	3.21
AUD	2.80	3.17	3.99	4.16	4.39
YEN	-0.28	-0.38	0.55	0.59	0.46
CNH	1.15	1.65	2.60	2.85	3.15
HKD	3.55	5.00	5.60	5.70	5.70

同业存放和非银存款参考报价

2022/12/08 放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.85	1.7 ~ 1.2
2w	2.2 ~ 2.1	1.75 ~ 1.2
1m	2.75 ~ 2.5	2.45 ~ 2.0
3m	2.73 ~ 2.5	2.42 ~ 1.7
6m	2.92 ~ 2.65	2.6 ~ 2.0
1y	3.01 ~ 2.66	2.62 ~ 2.25

2022/12/08 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

2022/12/08 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	/	/

2022/12/08 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 / Anqi Zhang, Honghe Meng, Allen Huang, Zhanglan Yang

联系人: Rochael Yoo
 邮箱: rochoel.yoo@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日报及更多资讯



免责声明:

以上所述及附加的所有信息(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