

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

【2022-12-12】

人民币回购及NCD

货币市场

周一，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
加权利率 (%)	1.0444	1.5776	1.6906	2.1654	2.3125	2.5000	2.6000
涨跌幅 (BP)	-1.47	-15.17	3.61	50.35	11.79	-	-4.30

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.0520	1.6100	1.7150	2.0060	2.2730	2.3920	2.4400	2.5140
涨跌幅 (BP)	-1.90	-14.90	8.00	2.80	1.40	1.30	1.10	1.40

【公开市场】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 20 亿元逆回购到期。

今日资金面整体均衡，日中有边际收敛。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+20bps 至+30bps 或 1.70%至 1.80%融出。7 天押利率加权融出，押存单、信用 1.70%不低于 R 或 1.80%至 1.90%融出。14 天押利率加权融出，押存单、信用 2.05%融出。1M 押利率 2.15%融出，押存单、信用 2.80%至 3.00%融出。午后各期限价格较上午相差不大，但融出报价减少，资金面收紧。临近尾盘利率隔夜供给充足，总体呈均衡偏松态势至收盘。（Coco Gao）

资金面情绪指数：50-54-50-47

存单市场

截至下午 5 点 00 分，12 月 12 日有 94 只同业存单发行，实际发行量 531.7 亿，12 月 13 日将有 127 只存单计划发行，计划发行量为 798.3 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，整体成交偏清淡。具体来看，1M（休二）国股询在 1.90%，AAA 大城商成交在 2.50%；3M 部分国股在 2.42%位置募集较好，AAA 部分城商在 2.50%-2.53%位置有成交；6M 大行国股询在 2.45%，AAA 多家城农商在 2.64%-2.65%位置交投活跃；9M 交投清淡，大行国股最高询在 2.50%，AAA 城农商行询在 2.45%至 2.70%；1Y 大行国股最高询在 2.60%，AAA 部分城农商行在 2.70%-2.72%有少量成交。（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 (%)	1.90	2.25	2.50	2.60	2.60
今日询价最高利率 (%)	1.90	2.25	2.45	2.50	2.60
涨跌幅 (BP)	0	0	-5	-10	0

二级存单交易方面：月内成交收益率较上周五基本持平，其余跨年期限成交收益率均呈上行趋势。具体来看：12 月到期，国股大行成交在 1.25%-1.35%，AAA 大城农商成交在 1.30%-1.40%；明年 1 月到期，国股大行春节前成交在 2.20%-2.25%，AAA 大城农商少量成交在 2.46%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.40%-2.46%，AAA 大城农商少量成交在 2.45%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.54%-2.57%，AAA 大城农商少量成交在 2.60%-2.63%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.52%-2.60%，AAA 大城农商成交在 2.58%-2.62%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.61%-2.69%，AAA 大城农商成交在 2.69%-2.73%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.65%-2.69%，AAA 大城农商成交在 2.70%-2.72%；明年 10-12 月到期，国股大行成交在 2.645%-2.70%，AAA 大城农商成交在 2.70%-2.75%。(Amanda Li)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	2.40	2.44	2.60	2.69	2.700
	AAA (非国股)	2.46	2.51	2.62	2.75	2.75
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	18	6	8	7	6.5
	AAA (非国股)	21	10	6	9	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较松，其他期限均衡，成交集中在 O/N-1W 期限，1M 和 3M 期限有部分成交。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.80%-3.82%，区间内均有成交；1W 市场买盘报在 4.10%-4.35%，成交在 4.10%-4.30%；2W 市场双边报价寥寥；1M 市场买盘积极，报在 4.30%-4.65%，部分成交在 4.48%-4.65%；2M 市场少量买盘报 4.70%-4.90%，卖盘寥寥；3M 市场买盘报 5.22%-5.60%，部分交投在 5.60%；6M 市场少量买盘报 5.39%、9M 市场少量买盘报 5.51%，1Y 市场少量买盘在 5.63%-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，交投集中在隔夜短期限，O/N 期限成交在 3.81%。

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 期限，1M 和 3M 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 3.75%-3.81%，区间内有成交；1W 市场买盘报在 4.10%-4.35%，区间内有成交；2W 市场少量买盘报 4.20%，成交寥寥；1M 市场买盘较积极，报在 4.55%-4.70%，成交在 4.55%-4.63%；2M 市场少量需求报 4.95%，暂无成交；3M 市场买盘报在 5.30%-5.46%，成交在 5.35%-5.40%；6M-1Y 长期限市场报价稀缺，交投清淡。(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	4.00	4.35
1M	4.40	4.45
3M	5.40	5.50
6M	5.50	5.55
1Y	5.60	5.65

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	4.25	4.60	5.45	5.70	5.65
GBP	3.32	3.33	4.42	4.82	4.96
EUR	1.35	1.62	2.71	3.08	3.14
AUD	2.99	3.10	3.93	4.15	4.26
YEN	-0.12	-0.32	0.55	0.57	0.37
CNH	0.90	1.75	2.60	2.85	3.15
HKD	3.10	4.85	5.45	5.60	5.60

同业存放和非银存款参考报价

2022/12/12 放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.85	1.3~ 1.1
2w	2.2 ~ 2.1	1.5 ~ 1.2
1m	2.85 ~ 2.6	2.55 ~ 2.05
3m	2.73 ~ 2.5	2.4~ 1.7
6m	2.92 ~ 2.65	2.5 ~ 2.0
1y	3.01 ~ 2.7	2.65~ 2.3

2022/12/12 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

2022/12/12 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	/	/

2022/12/12 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, Amanda Li, Allen Huang, Zhanglan Yang

联系人: Rachoel Yoo
邮箱: rachoel.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:
以上所述及增加的所有信息(以下简称“信息”)仅供以提供信息,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