

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

【2022-12-16】

人民币回购及NCD

货币市场

周五，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 (%)	1.2138	1.7325	1.6894	2.5327	2.7176	2.8246	3.1000	2.7000	2.8000
涨跌幅 (BP)	-0.62	24.79	-10.45	23.43	11.17	32.49	34.29	-	10.00

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.2240	1.7520	1.7370	2.1710	2.3390	2.4500	2.5080	2.5870
涨跌幅 (BP)	0.10	12.60	-0.80	4.80	1.80	1.60	1.80	1.80

【公开市场】央行开展了 410 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，因此当日净投放 390 亿元。

早盘资金面均衡，大行国股有部分融出。隔夜押利率加权至 1.95% 融出，押存单、信用 2.00% 至 2.40% 融出；7 天押利率加权至 2.20% 融出，押存单、信用 2.00% 至 2.40% 融出；14 天押利率 1.95% 融出，押存单、信用 2.20% 融出；21 天-1M 跨月融出报价较少，21 天跨月押利率不低于 2.40% 融出，押存单信用 3.20%-3.50% 融出。午盘资金面持续均衡，国股大行暂无融出，隔夜-7 天融出报价较上午减少；隔夜押存单降至 1.80% 融出。下午两点后，资金逐步宽松，隔夜慢慢降至加权附近融出，随后资金面呈均衡宽松态势收盘。(Bella Wang)

今日全天的资金面情绪指数：50-53-48-46

存单市场

截至下午 5 点 00 分，12 月 16 日有 93 只同业存单发行，实际发行量 680.7 亿，12 月 19 日将有 104 只存单计划发行，计划发行量为 822.3 亿。

今日一级存单各期限均为工作日到期，全天各期限均有成交，整体交投一般，其中 1M、3M 相对需求较多。具体来看，1M 国股询在 2.35%，AAA 城农商询在 2.50%-2.85%，部分城商行在 2.80%-2.85% 位置获得不错需求，均有募满；3M 国股大行询在 2.35%-2.50%，大行在 2.50% 位置起量并募满，AAA 城农商询在 2.55%-2.75%，大城商行在 2.58% 位置募满，其余城商行在 2.68% 和 2.75% 位置获得需求有一定募集量；6M 国股询在 2.60%-2.62%，

AAA 城农商询在 2.40%-2.80%，部分城农商在 2.70%-2.75%位置有少量成交；9M 国股大行询在 2.50%-2.63%，AAA 城农商询在 2.45%-2.85%，部分城农商行在 2.75%-2.76%位置募得少量需求；1Y 国股大行询在 2.55%-2.65%，AAA 城农商询在 2.50%-2.85%，部分城商行在 2.83%-2.85%位置获得需求。

(Bella Shen)

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 (%)	2.40	2.35	2.55	2.64	2.68
今日询价最高利率 (%)	2.35	2.50	2.62	2.63	2.65
涨跌幅 (BP)	-5	15	7	-1	-3

二级存单交易方面：月内成交收益率较昨日小幅下行，跨年各期限成交收益率较昨日都有所上行。

具体来看：12 月到期，国股大行主要成交在 1.00%-1.10%，AAA 大城农商成交在 1.00%-1.15%；明年 1 月到期，国股大行春节前成交在 2.40%-2.50%，AAA 大城农商零星成交在 2.60%-2.65%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.50%-2.54%，AAA 大城农商成交在 2.58%-2.65%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.58%-2.60%，AAA 大城农商零星成交在 2.65%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.62%-2.65%，AAA 大城农商暂无成交；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.71%-2.74%，AAA 大城农商少量成交在 2.745%-2.79%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.72%-2.735%，AAA 大城农商暂无成交；明年 10-12 月到期，国股大行成交在 2.71%-2.74%，AAA 大城农商成交在 2.78%-2.81%。(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)	2.50	2.52	2.64	2.735	2.74
	AAA (非国股)	2.62	2.65	2.75	2.78	2.79
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	5	2	1	1	2.0
	AAA (非国股)	2	10	7	2	2

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 0/N 和 1W 期限，1M 期限有部分交投，中长期限交投寥寥。具体来看：0/N 市场买盘报在 4.29%-4.31%，区间内均有成交；1W 市场买盘报在 4.30%-4.45%，部分成交在 4.35%-4.45%；2W 市场双边报价稀缺；1M 市场买盘报在 4.45%-4.68%，部分成交在 4.50%-4.68%；2M 市场少量买盘报 4.70%、3M 市场买盘报 5.34%-5.50%、6M 市场少量买盘报 5.49%、9M 市场少量买盘报 5.58%，1Y 市场少量买盘在 5.68%-5.70%，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，0/N 期限成交在 4.31%。

境内美金存单市场：今日境内美金存单市场交投寥寥，市场各期限询价情绪仍清淡。

境外美元拆借市场：今日境外美金市场流动性整体均衡，成交集中在 0/N-2W 短期限，1M 有部分成交，中长期限报价稀缺。具体来看，0/N 市场买盘报在 4.24%-4.32%，部分成交在 4.27%-4.32%；1W 市场买盘报在 4.25%-4.35%，部分成交在 4.30%-4.35%；2W 市场少量买盘报 4.35%-4.45%，成交在 4.43%-

4.45%；1M 附近市场买盘报在 4.50%-4.60%，部分成交在 4.60%；2M 市场少量买盘报 4.77%-4.78%、3M 市场买盘报在 5.05%-5.10%、6M 市场少量买盘报 5.40%-5.45%，成交寥寥；9M 和 1Y 市场双边暂无报价。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	4.28	4.31
1W	4.35	4.40
1M	4.55	4.65
3M	5.35	5.45
6M	5.45	5.50
1Y	5.55	5.60

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	4.33	4.55	5.15	5.40	5.50
GBP	3.27	3.19	4.09	4.51	4.84
EUR	2.03	1.49	2.49	2.92	3.29
AUD	2.96	2.87	3.67	3.95	4.29
YEN	0.33	-0.38	0.27	0.33	0.31
CNH	1.25	1.85	2.65	2.80	3.10
HKD	3.25	4.85	5.30	5.45	5.55

周评

央行本周共开展 6500 亿元 1 年期中期借贷便利 (MLF) 和 490 亿元 7 天期逆回购操作，因本周共有 5000 亿元 1 年期中期借贷便利 (MLF) 和 100 亿元 7 天期逆回购到期，当周实现净投放 1890 亿元。。

本周线下资金各期限吸收报价为：7 天 1.1%-1.5%，14 天 1.2%-1.75%，1 个月 2.05%-3.0%，3 个月 1.7%-2.58%，6 个月 2.0%-2.7%，1 年 2.3%-2.77%之间。

美金存放方面境内市场报价为：1 个月 4.28%，3 个月 4.35%，6 个月 4.62%，一年 5.02%。

本周非保本 R2 理财方面报价：1 个月 3.1%，3 个月 2.85%-3.45%；中长期方面，6 个月价格区间为 3.05%-3.60%，1 年期价格区间为 3.20%-3.75%。(Wendy Zhu)

以下为本周 Shibor (%) :

日期	2022-12-12	2022-12-13	2022-12-14	2022-12-15	2022-12-16
O/N	1.0520	1.0320	1.1990	1.2230	1.2240
1W	1.6100	1.7480	1.6690	1.6260	1.7520
2W	1.7150	1.6910	1.7320	1.7450	1.7370
1M	2.0060	2.0370	2.0650	2.1230	2.1710
3M	2.2730	2.2830	2.2980	2.3210	2.3390
6M	2.3920	2.4030	2.4120	2.4340	2.4500
9M	2.4400	2.4590	2.4720	2.4900	2.5080
1Y	2.5140	2.5320	2.5470	2.5690	2.5870



同业存放和非银存款参考报价

2022/12/16 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.85	1.2 ~ 1.1
2w	2.3 ~ 2.1	1.2 ~ 1.1
1m	2.85 ~ 2.6	3 ~ 2.3
3m	2.73 ~ 2.65	2.58 ~ 1.7
6m	2.92 ~ 2.7	2.7 ~ 2
1y	3.01 ~ 2.75	2.77 ~ 2.3

2022/12/16 美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

2022/12/16 非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	/	/

2022/12/16 非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

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