



【2022-11-09】

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
加权利率（%）	1.7969	1.8517	1.8007	1.8051	1.8305	1.9350
涨跌幅（BP）	5.11	3.24	4.32	6.05	15.66	/

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor（%）	1.8080	1.8550	1.8010	1.6980	1.8070	1.9080	2.0060	2.0620
涨跌幅（BP）	5.20	4.30	4.80	1.00	2.60	1.20	0.40	0.80

【公开市场】央行公开市场开展 80 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.00%，今日 180 亿元逆回购到期。

今日早盘资金面偏紧，非银押利率存单加权+30bps 融出；7 天押利率加权+3bps（限银行）融出，押存单 2.00%至 2.10%融出。14 天至 21 天押存单利率 2.00%融出。随后资金面慢慢趋向宽松，隔夜押利率债+15 bps 融出，押存单信用+15 至 30 bps 融出。7 天至 1.90%-1.95%融出，机构资金需求逐渐得到满足，资金面维持宽松到午间收盘。午后资金面继续宽松，隔夜慢慢出现减点融出，资金面宽松势态直至收盘。

今日全天的资金面指数：59-50-46-44

存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 9 日有 118 只同业存单发行，实际发行量 818.4 亿，11 月 10 日将有 137 只存单计划发行，计划发行量为 1136.2 亿。

一级存单方面：今日 1M、3M、1Y 到期日均为休息日，其余期限为工作日到期。上午情绪清淡，下午资金宽松后交投回暖。具体来看，1M（休一）

国股大行暂无报价，AAA 城农商询在 1.60%-1.70%；3M（休二）国股询在 1.85%-2.00%，AAA 城农商询在 1.95%-2.05%；6M 国股询在 1.98%-2.10%，部分国股在 2.10%位置募得量，AAA 城农商询在 2.05%-2.25%，部分城农商在 2.20%-2.25%位置募得不错需求；9M 国股大行询在 2.05%-2.18%，其中大行在 2.18%位置需求火爆，AAA 城农商询在 2.15%-2.28%，部分城商行在 2.28%位置募满；1Y（休二）受到期日在周末影响，今日 1y 交投清淡，国股大行询在 2.08%-2.16%，AAA 城农商询在 2.20%-2.38%，部分城商在 2.35%-2.38%位置有需求。(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（%）	1.35	2.00	1.98	2.05	2.15
今日询价最高利率（%）	/	2.00	2.10	2.18	2.16
涨跌幅（BP）	/	0	12	13	1

二级存单交易方面：除月内到期外，今日二级存单收益率继续上行。

具体来看：11 月到期，国股大行成交在 1.55%-1.70%，AAA 大城农商成交在 1.70%-1.80%；12 月到期，国股大行成交在 1.70%-1.75%，AAA 大城农商成交在 1.70%-1.75%；明年 1 月到期，国股大行少量成交在 1.95%-2.00%，AAA 大城农商成交在 2.01%-2.05%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.02%-2.05%，AAA 大城农商成交再 2.07%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.07%-2.10%，AAA 大城农商少量成交在 2.15%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.09%-2.13%，AAA 大城农商少量成交在 2.14-2.16%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.14%-2.18%，AAA 大城农商成交在 2.18%-2.22%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.145%-2.185%；AAA 大城农商成交在 2.22%-2.23%；明年 10 月到期，国股大行成交在 2.15%-2.19%，AAA 大城农商成交在 2.22%-2.23%；明年 11 月到期，国股大行成交在 2.15%-2.18%，AAA 大城农商少量成交在 2.25%。

(Scoot Zhang)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率（%）	AAA (国股)	1.72	2.045	2.13	2.18	2.19
	AAA (非国股)	1.74	2.07	2.15	2.22	2.25
与昨日收益变动对照（BP）	AAA (国股)	7	3.5	5	4.75	3
	AAA (非国股)	4	4	5	4	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整体延续偏紧，交投集中在隔夜和 1W 短期限，1M 期限有少量成交，其他期限交投清淡。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 3.80%-3.95%，成交集中在 3.90%-3.95%；2W 市场少量买盘报在 3.92%-4.00%，成交寥寥；1M 市场买盘报在 4.05%-4.10%，部分成交在 4.10%；2M 市场少量买盘报 4.50%-4.65%、3M 市场买盘报 4.84%-5.15%、6M 少量买盘报 5.03%、9M 少量买盘报 5.17%、1Y 少量买盘报 5.31%-5.60%，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 3.80%。

境内美金存单市场：今日境内美金存单市场交投情绪清淡，市场有 1M 城商行询价报在 4.10%，1Y 外资行询价报在 5.60%。

境外美元拆借市场：今日境外美金市场流动性整体仍偏紧，隔夜和 1W 短期限有部分交投，跨年 2M 期限有部分成交，其他期限成交稀缺。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.76%-3.82%，成交集中在 3.80%-3.82%；1W 市场买盘报在 3.80%-3.90%，部分成交在 3.90%；2W 市场买盘报 3.90%-3.91%，卖盘寥寥；1M 市场买盘报 4.00%-4.10%，交投清淡；跨年 2M 市场买盘报 4.60%-4.70%，部分成交在 4.65%-4.70%；3M 市场买盘价格报在 5.10%-5.45%，暂无成交；长期限市场，6M 少量买盘报在 5.35%-5.75%、9M 少量买盘报在 5.45%-5.66%、1Y 少量买盘报在 5.55%-5.90%，融出意向寥寥。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	3.79	3.82
1W	3.85	3.90
1M	4.00	4.05
3M	5.10	5.20
6M	5.30	5.40
1Y	5.50	5.60

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	3.85	4.05	5.55	5.80	6.00
GBP	2.94	3.11	4.26	4.70	5.10
EUR	1.41	1.56	2.53	2.96	3.34
AUD	2.78	3.01	4.06	4.33	4.76
YEN	-0.19	-0.01	0.56	0.56	0.49
CNH	1.15	1.45	2.60	2.75	2.90
HKD	2.15	3.00	4.75	5.05	5.45

同业存放和非银存款参考报价

2022/11/09 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	1.85 ~ 1.6	1.55 ~ 1.44
2w	2.2 ~ 1.6	1.55 ~ 1.44
1m	2.3 ~ 1.95	1.8 ~ 1.5
3m	2.73 ~ 2.24	2.1 ~ 1.85
6m	2.92 ~ 2.5	2.2 ~ 2
1y	3.01 ~ 2.66	2.3 ~ 1.9

2022/11/09 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

2022/11/09 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	/	/

2022/11/09 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

文 /Bella Wang, Scoot Zhang, 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