

收盘日评 银行间货币市场

常规报告系列

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

【2022-05-19】

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	DR9M
加权利率 (%)	1.3952	1.5848	1.7006	1.8436	1.8500	1.6500	2.0500	2.4000
涨跌幅 (BP)	6.85	2.98	6.11	10.65	20.00	/	0.00	/

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.4140	1.6540	1.6690	1.9370	2.0670	2.2080	2.2750	2.3430
涨跌幅 (BP)	8.80	0.70	2.40	-0.40	-1.10	-1.40	-1.30	-1.60

【公开市场】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，5月19日以利率招标方式开展了100亿元7天期逆回购操作，中标利率2.10%。Wind数据显示，今日100亿元逆回购到期，因此实现零回笼零投放。

今日资金面整体均衡。开盘伊始，隔夜押利率债加权+5bps融出，押非利率债加权+15bps至加权+30bps融出。隔夜加权较昨日有所上涨。7天银行押利率债1.60%融出，非银1.65%至1.80%融出。14天至1M银行加权融出，非银1.80%至2.10%融出，21天至1M报价较少，成交寥寥。资金面保持均衡态势直至午间收盘。下午隔夜押利率债1.40%融出，押非利率债1.50%至1.75%融出。7天银行加权融出，非银1.70%至1.80%融出。资金面呈现均衡态势直至收盘。(Queen Cai)

情绪指数：46-48-50-46

存单市场

存单市场

截至下午5点30分，5月19日有92只同业存单发行，实际发行量541.1亿，5月20日将有125只存单计划发行，计划发行量为1403亿。

一级存单方面：今日各期限均为工作日到期，6M和1Y期限募集表现较好。具体来看，1M国股询在1.45%，AAA城农商行询在1.52%至1.58%；3M国股大行询在1.73%至1.75%，AAA城农商行询在1.75%至1.85%；6M国股询在1.93%，AAA城农商行询在1.95%至2.10%，个别城农商行在2.05%-2.06%提前募满；9M国股询在2.13%，AAA城农商行询在2.15%至2.25%；1Y国股大行询在2.20%至2.26%，部分国股大行提价至2.26%后市场反映热烈，募集表现较好，AAA城农商行询在2.28%至2.35%，部分城农商行在2.28%-2.30%和2.34%-2.35%募得较好需求。

附：国股/大行 NCD 一级询价利率

国股/大行存单	1M	3M	6M	9M	1Y
今日询价最高利率 (%)	1.45	1.75	1.93	2.13	2.26
昨日询价最高利率 (%)	1.50	1.75	1.95	2.15	2.26
涨跌幅 (BP)	-5	0	-2	-2	0

二级存单交易方面：今日二级市场交投活跃。具体来看：5月到期，国股大行成交在1.30%-1.35%，AAA大城农商少量成交在1.50%；6月到期，国股AAA大城农商成交在1.50%；7月到期，国股大行成交在1.70%-1.75%，AAA大城农商少量成交在1.77%；8月到期，国股大行成交在1.75%-1.78%，AAA大城农商成交在1.75%-1.80%，AAA大城农商成交在1.80%-1.81%；10月到期，国股大行成交在1.91%-1.95%，AAA大城农商成交寥寥；11-12月到期，国股大行成交在1.94%-1.96%，下午有所反弹成交在1.96%-1.97%，AAA大城农商成交在1.97%；明年1月到期，国股大行成交在2.18%，少量成交在2.14%，AAA大城农商成交在2.15%-2.17%，下午有所反弹成交在2.17%-2.20%，AAA大城农商成交在2.22%；明年2-3月到期，国股大行早盘成交在2.15%-2.17%，下午有所反弹成交在2.17%-2.20%，AAA大城农商成交在2.22%；明年4月到期，国股大行成交在2.30%；明年5月到期，国股大行在2.26%-2.265%，AAA大城农商成交在2.30%-2.31%。(Xiaoxian Wang)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	1.47	1.77	1.96	2.17	2.26
	AAA (非国股)	1.50	1.79	1.97	2.22	2.30
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	-2	-1	-1	-1	-1
	AAA (非国股)	0	-1	-1	-1	0

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短期稍松，中长期稍紧，隔夜期限交投活跃，1W-1M和3M期限有少量成交，更长期限仍无成交。具体来看：隔夜市场成交集中在0.74%-0.76%，价格无明显波动；1W市场集中成交在0.79%-0.80%，价格与昨日相似；2W市场有少量成交在0.85%，价格同昨日持平；1M市场交投在1.00%-1.03%，价格下行15BP左右；2M市场双边报价仍稀缺，成交寥寥；3M市场买盘报在

1.50%-1.80%，少量成交在 1.70%-1.80%，价格上行 10-20BP；6M 市场少量买盘报 1.80%-2.00%，卖盘寥寥；9M-1Y 长期市场交投情绪仍显清淡。

境内美金回购市场：今日境内美金回购市场流动性稍松，少量交投在隔夜短期限，有 O/N 期限成交在 0.74%。

境内美金存单市场：今日境内美金存单市场交投情绪稍显清淡，有 1M 城商行发行意向报在 1.00%-1.05%；6M 城商行发行意向报在 1.95%-2.00%。

境外美元拆借市场：今日境外美金市场流动性整体偏紧，部分成交在 O/N-1W 期限，1M 和 3M 期限有少量成交，更长期限交投清淡。具体来看，O/N 市场需求价格报在 0.75%-0.83%，成交集中在 0.75%-0.76%，价格小幅下行 6-7BP；1W 需求价格报在 0.78%-0.85%，成交集中在 0.78%-0.83%，价格与昨日相似；2W 市场买盘报在 0.83%-0.88%，成交寥寥，价格无明显波动；1M 市场需求报在 1.00%-1.05%，少量成交在 1.05%，价格无明显波动；2M 市场需求报在 1.30%-1.45%，价格同昨日相似，成交寥寥；3M 市场需求报在 1.60%-1.66%，有少量成交在 1.65%-1.66%，价格小幅上行 5-6BP；6M 市场买盘报在 2.10%-2.25%，卖盘寥寥，价格与昨日相似；9M 市场少量需求报 2.45%、1Y 市场买盘报在 2.65%-2.80%，价格无明显波动，暂无成交。(Zhe Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	0.74	0.76
1W	0.77	0.80
1M	1.00	1.15
3M	1.50	1.60
6M	1.90	2.00
1Y	2.40	2.50

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	0.80	1.00	1.66	2.20	2.80
GBP	0.88	0.98	1.41	1.86	2.17
EUR	-0.85	-0.59	-0.31	0.08	0.39
AUD	0.13	0.47	1.48	1.96	2.59
YEN	-0.35	-0.19	-0.04	0.05	-0.05
CNH	1.75	2.35	2.65	2.85	3.05
HKD	0.04	0.15	0.80	1.60	2.45

同业存放和非银存款参考报价

2022/05/19 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	1.95 ~ 1.55	1.15 ~ 1.05
2w	2.15 ~ 1.65	1.4 ~ 1.3
1m	2.3 ~ 1.9	1.5 ~ 1.4
3m	2.7 ~ 2.25	2 ~ 1.73
6m	2.95 ~ 2.5	2.1 ~ 1.93
1y	3.05 ~ 2.68	2.35 ~ 2.25

2022/05/19 美金存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	0.4 ~ 0.1	L-10 ~ L-10
2w	0.5 ~ 0.15	L-10 ~ L-10
1m	0.6 ~ 0.25	L+10 ~ L-10
3m	0.7 ~ 0.35	L+10 ~ L-15
6m	0.8 ~ 0.5	L+0 ~ L-15
1y	1.3 ~ 0.95	L+20 ~ L-10

2022/05/19 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	/	/

2022/05/19 非银存款美金各期限双边价格

期限	融出	融入
1W	/	/
2W	/	/
1m	1.6 ~ 1.1	1 ~ 0.65
3m	1.75 ~ 1.2	1.15 ~ 0.75
6m	2.3 ~ 1.6	1.5 ~ 0.9
1y	2.55 ~ 1.7	1.65 ~ 1.15

文 / Queena Cai, Xiaoxian Wang, Zhe Huang, Zhanglan Yang

联系人: Rochael Yoo
 邮箱: rochael.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:

以上所登及附加的所有信息(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