

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

【2022-11-28】

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	DR4M	DR6M	DR9M
加权利率 (%)	1.0284	1.8366	1.8942	2.0167	2.0333	2.2788	2.45	2.4875	2.5
涨跌幅 (BP)	0.37	10.43	-2.95	6.63	-	5.36	-	-	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.033	1.881	1.87	1.913	2.185	2.298	2.358	2.417
涨跌幅 (BP)	1.2	13.7	-9	-1.1	-0.3	-0.4	-0.5	-0.2

【公开市场】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，央行公开市场开展 550 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%。今日 30 亿元逆回购到期。

今日资金面整体均衡，午后略有收敛。具体来看：早盘大行国股有部分融出。隔夜押利率加权至+10bps 融出，押存单、信用加权 1.60%至加权+20bps 不低于 1.70%融出。7 天押利率加权融出，押存单、信用 2.05%至 2.30%融出。14 天银行押利率加权融出，非银 2.10%至 2.15%融出，21 天-1M 融出较少，成交寥寥。午盘后资金面受融出减少影响略有收敛，股份制午后融出寥寥，隔夜押存单、信用加权+20bps 至 1.70%融出，7 天押存单 2.00%至 2.15%融出。整体呈均衡收盘。（Susan Gu）

资金面情绪指数：48-47-50-50

存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 28 日有 92 只同业存单发行，实际发行量 868.5 亿，11 月 29 日将有 96 只存单计划发行，计划发行量为 1111 亿。

一级存单方面：今日各期限均为工作日到期，1M 和 3M 成交较为活跃。具体来看，1M 国股询在 1.60%，AAA 城农商行询在 1.82%至 1.85%，大城商 1.85% 上午募满截单；3M 国股大行询在 2.10%至 2.20%，大行 2.19%、股份制 2.19%至 2.20%募集较好，AAA 城农商行询在 2.20%至 2.45%，好资质城商行 2.25% 需求旺盛满量较为迅速；6M 国股询在 2.20%至 2.34%，大行 2.34%有成交，AAA 城农商行询在 2.30%至 2.45%；9M 大行国股询在 2.25%至 2.34%，AAA 城农商行询在 2.35%至 2.50%；1Y 大行国股询在 2.30%至 2.45%，股份制 2.45%有一定量成交，AAA 城农商行询在 2.33%至 2.55%。（Susan Gu）

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 (%)	1.60	2.20	2.32	2.27	2.40
今日询价最高利率 (%)	1.60	2.20	2.34	2.34	2.45
涨跌幅 (BP)	0	0	2	7	5

二级存单交易方面：与上周五收盘相比，今日各期限存单收益率变动不大。

具体来看：11 月到期，国股大行成交在 1.10%-1.20%，AAA 大城农商成交寥寥；12 月到期，国股大行成交在 1.70%-1.75%，AAA 大城农商成交在 1.75%-1.80%；明年 1 月到期，国股大行成交在 2.18%-2.20%，AAA 大城农商成交在 2.19%-2.20%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.18%-2.20%，AAA 大城农商少量成交在 2.25%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.30%-2.34%，AAA 大城农商成交在 2.35%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.32%-2.35%，AAA 大城农商成交在 2.39%-2.40%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.40%-2.435%，AAA 大城农商成交在 2.45%-2.47%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.41%-2.44%；AAA 大城农商成交在 2.46%-2.50%；明年 10-11 月到期，国股大行成交在 2.44%-2.46%，AAA 大城农商成交在 2.48%-2.50%。(Scott 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)	1.75	2.20	2.35	2.44	2.46
	AAA (非国股)	1.8	2.25	2.40	2.47	2.50
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	5	0	0	1	1
	AAA (非国股)	0	2	4	-3	-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整体呈现由紧转松趋势，成交集中在 O/N-1W 短期限，2W 期限有部分成交，更长期限成交稀缺。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.79%-3.82%，成交集中在 3.80%-3.82%，少量成交在 3.79%；1W 市场买盘报在 3.90%-4.00%，成交集中在 3.90%-3.99%；2W 市场买盘报在 3.95%-4.10%，部分成交在 3.95%；1M 市场买盘报在 4.15%-4.30%，成交寥寥；2M 市场少量买盘报 4.70%、3M 市场买盘报 5.12%-5.60%、6M 市场少量买盘报 5.29%-5.80%、9M 市场少量买盘报 5.41%，1Y 市场少量买盘在 5.53%，交投清淡。

境内美金回购市场：今日境内美金回购市场流动性均衡，少量交投在隔夜短期限，有 O/N 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情绪清淡，市场有 1M 股份制询价报在 4.30%。

境外美元拆借市场：今日境外美金市场流动性整体均衡偏紧，交投集中在 O/N 期限，1W 和 1Y 期限有部分成交，其他期限暂无成交。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.75%-3.82%，成交集中在 3.80%-3.82%；1W 市场买盘报在 3.85%-3.93%，部分成交在 3.93%；2W 市场买盘报 4.00%-4.05%，部分卖盘报 4.08%；1M 市场买盘报 4.15%-4.21%，部分卖盘报 4.50%；2M 市场买盘报 4.90%-5.00%、3M 市场少量买盘报在 5.45%、6M 市场买盘报在 5.65%-5.80%、9M 市场少量买盘报 5.77%，均无成交；1Y 市场少量交投在 5.80%。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	3.79	3.81
1W	3.90	4.00
1M	4.15	4.25
3M	5.40	5.50
6M	5.45	5.60
1Y	5.55	5.65

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	3.90	4.20	5.45	5.80	5.95
GBP	2.96	3.29	4.37	4.87	5.12
EUR	1.46	1.63	2.64	3.14	3.31
AUD	2.88	3.04	4.02	4.35	4.59
YEN	-0.09	-0.15	0.09	0.11	0.22
CNH	1.15	1.25	2.55	2.85	3.05
HKD	4.05	4.05	5.45	5.65	5.85



同业存放和非银存款参考报价

2022/11/28 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.85	1.8 ~ 1.3
2w	2.2 ~ 2.1	1.7 ~ 1.5
1m	2.3 ~ 1.95	1.8 ~ 1.5
3m	2.73 ~ 2.5	2.25 ~ 2.05
6m	2.92 ~ 2.6	2.34 ~ 2.0
1y	3.01 ~ 2.66	2.5 ~ 2.3

2022/11/28 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

2022/11/28 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	/	/

2022/11/28 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