

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

【2022-11-30】

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	DR2M
加权利率 (%)	1.5684	2.0203	2.0911	2.0348	2.3000
涨跌幅 (BP)	53.98	14.15	20.92	2.08	1.50

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.5150	1.9150	1.9660	1.9150	2.1930	2.3050	2.3640	2.4350
涨跌幅 (BP)	49.20	5.00	10.40	0.60	0.70	0.30	0.50	1.20

【公开市场】央行公开市场开展 1700 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。

今日为月末最后一个交易日，早盘较昨日收敛，资金面偏紧，大行有部分融出。隔夜融出银行报价较少，非银隔夜 3.50-4.00%融出，7 天银行押利率 2.20%融出，非银押存单信用 2.50%融出，14 天至 1M，报价较少，融出寥寥。中午过后资金面持续收敛，隔夜押利率存单 3.80%至 4.50%融出。随后资金面逐步放松，隔夜价格银行降至加权至减点融出，资金面呈均宽松态势收盘。（Bella Wang）

今日资金面情绪指数：59-57-55-50

存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 30 日有 48 只同业存单发行，实际发行量 338.9 亿，12 月 1 日将有 43 只存单计划发行，计划发行量为 106.4 亿。

一级存单方面：今日 3M、6M 为工作日到期，1M、9M、1Y 为休息日到期，全天交投清淡，成交寥寥。具体来看，1M（休一）国股大行询在 1.70%，AAA 城农商询在 1.75%-2.05%；3M 国股大行询在 2.10%-2.15%，AAA 城农商询在 2.20%-2.45%；6M 国股大行询在 2.30%-2.35%，AAA 城农商询在 2.35%-2.55%；9M（休二）国股大行询在 2.30%-2.32%，AAA 城农商询在 2.40%-2.60%；1Y（休二）国股大行询在 2.35%，AAA 城农商询在 2.47%-2.60%，部分城农商在 2.52%少量募集。（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 (%)	1.85	2.10	2.35	2.35	2.45
今日询价最高利率 (%)	1.70	2.15	2.35	2.32	2.35
涨跌幅 (BP)	-15	5	0	-3	-10

二级存单交易方面：相比昨日成交，今日年内期限存单收益率略有上升，其余期限存单收益率均有所下降。

具体来看：12 月到期，国股大行成交在 1.70%-1.85%，AAA 大城农商成交在 1.45%-1.95%；明年 1 月到期，国股大行成交在 2.24%-2.25%，AAA 大城农商少量成交在 2.20%-2.30%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.24%-2.30%，AAA 大城农商成交在 2.21%-2.30%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.36%，AAA 大城农商成交在 2.40%-2.41%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.35%-2.40%，AAA 大城农商少量成交在 2.40%-2.44%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.45%-2.48%，AAA 大城农商成交在 2.51%-2.54%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.455%-2.48%；AAA 大城农商少量成交在 2.52%-2.55%；明年 10-11 月到期，国股大行成交在 2.46%-2.50%，AAA 大城农商成交在 2.53%-2.55%。(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)	1.78	2.25	2.38	2.47	2.48
	AAA (非国股)	1.90	2.30	2.40	2.54	2.56
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	-2	-2	0	-2	-2
	AAA (非国股)	5	0	-2	-1	-3

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均衡偏紧，成交集中在 O/N-2W 短期限，1M 期限有少量成交，中长期期限交投清淡。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 3.90%-4.00%，部分交投在 3.90%-3.97%；2W 市场买盘报在 4.00%-4.10%，部分成交在 4.03%-4.09%；1M 市场买盘报在 4.15%-4.20%，少量成交在 4.20%；2M 市场少量买盘报 4.70%-5.00%、3M 市场买盘报 5.10%-5.50%、6M 市场少量买盘报 5.31%-5.75%、9M 市场少量买盘报 5.43%，1Y 市场少量买盘在 5.55%-5.80%，均无成交。

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 股份制成功发行 4.30%。

境外美元拆借市场：今日境外美金市场流动性整体偏紧，成交集中在 O/N-1W 期限，3M 期限有部分卖盘，成交稀缺。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.76%-3.83%，成交集中在 3.80%-3.83%；1W 市场买盘报在 3.85%-3.93%，部分成交在 3.92%-3.93%；2W 市场买盘报 4.00%-4.05%、1M 市场买盘报 4.20%-4.60%，成交寥寥；2M 市场买盘报 4.80%-5.00%，卖盘寥寥；3M 市场买盘集中报在 5.40%-5.55%，部分卖盘报在 5.60%附近；长期限市场，6M 买盘报在 5.75%-5.77%、9M 暂无买盘报价，1Y 买盘报在 5.80%-5.85%，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	3.79	3.81
1W	3.90	3.97
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	5.85
GBP	2.98	2.77	4.36	4.86	5.08
EUR	1.47	0.98	2.64	3.12	3.27
AUD	2.79	2.61	3.89	4.23	4.46
YEN	-0.07	-0.94	0.15	0.20	0.25
CNH	1.15	1.35	2.45	2.85	3.05
HKD	3.95	4.20	5.35	5.55	5.65

同业存放和非银存款参考报价

2022/11/30 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.85	1.65 ~ 1.3
2w	2.2 ~ 2.1	1.65 ~ 1.5
1m	2.3 ~ 1.95	1.85 ~ 1.5
3m	2.73 ~ 2.5	2.25 ~ 2.05
6m	2.92 ~ 2.6	2.4 ~ 2.0
1y	3.01 ~ 2.66	2.51 ~ 2.3

2022/11/30 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

2022/11/30 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	/	/

2022/11/30 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, Scott Zhang, 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