



【2022-11-10】

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
加权利率（%）	1.8135	1.8861	1.8713	1.8536	1.7958	1.9900	2.0000
涨跌幅（BP）	1.66	3.44	7.06	4.85	-3.47	5.50	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor（%）	1.826	1.938	1.846	1.700	1.838	1.916	2.020	2.076
涨跌幅（BP）	1.80	8.30	4.50	0.20	3.10	0.80	1.40	1.40

【公开市场】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，11月10日以利率招标方式开展了90亿元7天期逆回购操作，中标利率2.00%。Wind 数据显示，今日70亿元逆回购到期，因此当日净投放20亿元。

今日资金面早盘大行国股有部分融出，隔夜押利率加权+10bps至2.00%融出，非利率加权+20bps至加权+30bps融出。7天押利率加权融出，非利率1.85%至1.95%融出。14天银行加权融出，非银1.95%至2.00%融出。21天至1M融出较少，21天非银2.25%融出，1M非银2.10%融出，成交寥寥。随后资金面慢慢走向宽松，资金需求大部分得到满足，隔夜价格下降至押非利率加权-加权+10bps融出，资金面维持均衡偏松态势至午间收盘。午后资金延续偏宽松态势，隔夜非利率1.85%-1.90%融出，7天非利率1.85%至1.88%融出。隔夜逐渐出现减点融出，维持宽松直至收盘。(Queena Cai)

今日全天的资金面指数：54-49-46-43

存单市场

截至下午5点30分，11月10日有128只同业存单发行，实际发行量899.5亿，11月11日将有128只存单计划发行，计划发行量为894.2亿。一级存单方面：今日6M为休息日到期，其余期限为工作日到期，总体来看1Y期限交投相对较活跃，买盘情绪较弱。具体来看，1M国股询在1.40%，AAA城农商行询在1.60%至1.85%，个别城商在1.83%-1.85%位置募集部分需求；3M国股询在2.00%至2.08%，个别国股提价至2.08%后有成交，AAA城农商行询在2.00%至2.15%；6M国股询在2.00%至2.05%，AAA城农商行询在2.05%至2.25%；9M国股大行询在2.18%至2.22%，部分国股在2.22%位置募集到量，AAA城农商行询在2.15%至2.33%；1Y国股大行询在2.21%至2.23%，部分国股大行在2.23%位置募集到量，AAA城农商行询在2.20%至2.40%，大城农商成交在2.30%位置，其他城农商行在2.35%-2.37%有少量需求。(Anqi Zhang)

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（%）	/	2.00	2.10	2.18	2.16
今日询价最高利率（%）	1.40	2.08	2.05	2.22	2.23
涨跌幅（BP）	/	8	-5	4	7

二级存单交易方面：今日二级存单收益率依旧保持上升态势。

具体来看：11月到期，国股大行成交在1.58%-1.72%，AAA大城农商成交在1.70%-1.75%；12月到期，国股大行成交在1.70%-1.81%，AAA大城农商成交在1.71%-1.85%；明年1月到期，国股大行少量成交在2.00%-2.11%，AAA大城农商成交较少；明年2-3月到期，国股大行成交在2.04%-2.12%，AAA大城农商成交再2.08%-2.13%；明年4月到期，国股大行成交在2.12%-2.20%，AAA大城农商少量成交在2.18%-2.25%；

明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.14%-2.20%，AAA 大城农商少量成交在 2.23%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.18%-2.24%，AAA 大城农商成交在 2.24%-2.30%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.19%-2.24%；AAA 大城农商成交在 2.24%-2.30%； 明年 10 月到期，国股大行成交在 2.19%-2.23%，AAA 大城农商成交在 2.25%-2.30%；明年 11 月到期，国股大行成交在 2.18%-2.24%，AAA 大城农商少量成交在 2.25%-2.30%。(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)	1.81	2.12	2.20	2.24	2.24
	AAA (非国股)	1.85	2.14	2.23	2.30	2.30
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	9	7.5	7	6	5
	AAA (非国股)	11	7	8	8	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隔夜期限较昨日转松，其他期限偏紧，交投集中在隔夜期限，1W-1M 和 3M 期限有少量交投，其他期限暂无成交。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.79%-3.83%，区间内均有成交；1W 市场买盘报在 3.84%-3.95%，成交在 3.90%；2W 附近市场少量买盘报在 3.90%-4.00%，成交在 3.90%；1M 市场买盘报在 4.03%-4.10%，区间内有少量成交；2M 市场少量买盘报 4.50%-4.65%，成交寥寥；3M 市场买盘报 4.88%-5.40%，成交在 5.40%；6M 少量买盘报 5.06%、9M 少量买盘报 5.20%、1Y 少量买盘报 5.34%-5.60%，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较松，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 外资行询价报在 4.10%，2M 外资行询价报在 4.65%、3M 外资行询价报在 5.25%、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偏紧，隔夜和 1W 短期限有部分成交， 3M 期限有少量交投，其他期限暂无成交。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.80%-3.83%，区间内均有成交；1W 市场买盘报在 3.85%-3.90%，部分成交在 3.90%；2W 市场少量买盘报 3.94%-3.95%，交投清淡；1M 市场买盘报 3.97%-4.10%，卖盘寥寥；跨年 2M 市场买盘报 4.65%-4.75%，成交寥寥；3M 市场买盘价格报在 5.30%-5.45%，少量成交在 5.40%；长期限市场，6M 少量买盘报在 5.48%-5.70%、9M 少量买盘报在 5.60%-5.90%、1Y 少量买盘报在 5.75%-6.03%，鲜有成交。(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	3.87	3.90
1M	4.05	4.10
3M	5.20	5.30
6M	5.30	5.40
1Y	5.60	5.70

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	5.50	5.80	6.05
GBP	2.96	3.12	4.22	4.71	5.15
EUR	1.40	1.55	2.49	2.96	3.37
AUD	2.77	3.01	3.99	4.27	4.79
YEN	-0.19	-0.02	0.50	0.56	0.55
CNH	1.15	1.45	2.65	2.75	2.90
HKD	2.25	3.00	4.95	5.05	5.45

同业存放和非银存款参考报价

2022/11/10 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 ~ 2
6m	2.92 ~ 2.5	2.22 ~ 2
1y	3.01 ~ 2.66	2.38 ~ 1.9

2022/11/10 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

2022/11/10 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	/	/

2022/11/10 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 /Anqi Zhang, Queena Cai, Scoot Zhang, Allen Huang, Zhanglan Yang

联系人: Rachael Yoo
邮箱: rachael.yoo@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日报及更多资讯



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