

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

【2022-11-14】

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
加权利率 (%)	1.6544	1.8403	1.8478	1.9245	1.9181	2.1274
涨跌幅 (BP)	-4.12	1.83	2.16	5.48	3.16	17.43

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.646	1.846	1.874	1.768	1.912	1.948	2.071	2.133
涨跌幅 (BP)	-5.8	-4.2	4.9	5.2	4.4	2.4	3.0	4.1

【公开市场】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，今日进行 50 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.00%，持平上次。今日有 20 亿元逆回购到期。

今日资金面早盘均衡，午盘开始逐步收紧。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+20bps 融出。7 天押利率加权融出，押存单、信用 1.85%至 1.90%融出。14 天押利率 1.65%，非银押存单、信用 1.90%至 1.95%融出，21 天-1M 融出较少，成交寥寥，午盘前资金面逐步收紧，午后股份制融出寥寥，延续收敛态势。隔夜押存单、信用 1.80%至+20bps 融出。整体呈均衡偏紧收盘。(Shanshan Gu)

今日全天的资金面指数：51-50-58-57

存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 14 日有 107 只同业存单发行，实际发行量 655.8 亿，11 月 15 日将有 101 只存单计划发行，计划发行量为 601.9 亿。

一级存单方面：今日各期限均为工作日到期，收益率继续上行，交投清淡，成交弱。具体来看，1M AAA 城农商行询在 1.60%至 1.90%，好资质城商行 1.90%成交较好；3M 国股询在 2.10 至 2.27%，股份制 2.27%少量募集，AAA 城农商行询在 2.10%至 2.30%；6M 国股询在 2.28%至 2.30%，AAA 城农商行询在 2.15%至 2.40%；9M 大行国股询在 2.38%至 2.42%，AAA 城农商行询在 2.20%至 2.46%；1Y 大行国股询在 2.40%至 2.45%，下午提价 2.45%后有些许募集，AAA 城农商行询在 2.25%至 2.55%。(Shanshan 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 (%)	1.80	2.08	2.10	2.26	2.28
今日询价最高利率 (%)	/	2.27	2.30	2.42	2.45
涨跌幅 (BP)	/	19	20	16	17

二级存单交易方面：各期限成交收益率均有大幅上行，6M-1Y 期限成交收益率呈先上后下趋势，尾盘成交收益率较前一交易日上行 15bp 左右。具体来看：11 月到期，国股大行成交在 1.60%-1.73%，AAA 大城农商成交在 1.65%-1.75%；12 月到期，国股大行成交在 1.70%-1.83%，AAA 大城农商成交在 1.85%附近；明年 1 月到期，国股大行少量成交在 2.23%-2.30%，AAA 大城农商成交在 2.28%-2.38%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.12%-2.35%，AAA 大城农商成交在 2.33%附近；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.30%-2.45%，AAA 大城农商成交在 2.40%-2.45%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.30%-2.45%，AAA 大城农商成交在 2.38%-2.48%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.36%-2.48%，AAA 大城农商成交在 2.45%-2.535%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.31%-2.48%；AAA 大城农商成交在 2.37%-2.42%；明年 10-11 月到期，早盘国股大行成交 2.34%-2.36%，随后一路上行，最高成交在 2.50%附近，全天最高上行 20bp 左右，尾盘成交在 2.46%-2.465%，AAA 大城农商少量成交在 2.50%-2.55%。(Ellie Meng)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	1.80	2.31	2.39	2.45	2.465
	AAA (非国股)	1.85	2.34	2.42	2.48	2.50
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	0	14	16	18	15.5
	AAA (非国股)	0	14	12	12	13

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均衡，其他期限偏紧，交投集中在隔夜和 1W 期限，1M 和 2M 期限有部分成交，其他期限成交寥寥。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.78%-3.82%，成交在 3.80%-3.82%；1W 市场买盘报在 3.84%-3.95%，成交在 3.90%-3.93%；2W 市场少量买盘报在 3.93%-3.95%，成交寥寥；1M 市场买盘报在 4.05%-4.15%，部分成交在 4.15%；2M 市场买盘报 4.50%-4.70%，部分成交在 4.68%-4.70%；3M 市场买盘报 4.92%-5.45%、6M 市场少量买盘报 5.10%、9M 少量买盘报 5.25%、1Y 少量买盘报 5.38%-5.80%，暂无成交。

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 3.80%。

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 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较紧，隔夜和 1W 短期限有部分成交，3M 和 6M 长期限有少量成交。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.80%-3.83%，成交在 3.80%-3.82%；1W 市场买盘报在 3.82%-3.93%，成交在 3.90%-3.93%；2W 市场少量买盘报 3.87%-3.95%，成交寥寥；1M 市场买盘报 4.00%-4.08%，部分卖盘报 4.30%；2M 市场买盘报 4.60%-4.75%，成交寥寥；3M 市场买盘价格报在 5.25%-5.50%，区间内有少量成交；6M 市场少量交投在 5.70%左右；9M 市场双边报价寥寥；1Y 少量买盘报在 5.82%-5.85%，暂无成交。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
T/N	3.79	3.82
1W	3.87	3.92
1M	4.05	4.10
3M	5.25	5.35
6M	5.30	5.40
1Y	5.45	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	4.10	5.50	5.70	5.90
GBP	3.05	3.21	4.31	4.71	5.13
EUR	1.46	1.60	2.58	3.08	3.39
AUD	2.88	3.10	4.08	4.25	4.69
YEN	-1.30	0.02	0.59	0.59	0.58
CNH	1.25	1.55	2.75	3.05	3.25
HKD	2.75	3.05	4.85	5.05	5.65

同业存放和非银存款参考报价

2022/11/14 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.8	1.7 ~ 1.5
2w	2.2 ~ 1.95	1.9 ~ 1.5
1m	2.3 ~ 1.95	1.88 ~ 1.5
3m	2.73 ~ 2.4	2.35 ~ 1.95
6m	2.92 ~ 2.5	2.43 ~ 2
1y	3.01 ~ 2.66	2.5 ~ 2.05

2022/11/14 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

2022/11/14 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	/	/

2022/11/14 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 /Shanshan Gu, Ellie Meng, 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”)仅供以提供信息,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