



【2022-11-23】

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	DR1M	DR2M	DR6M
加权利率 (%)	1.0452	1.5982	1.9484	1.9850	2.0269	2.0604	2.4726
涨跌幅 (BP)	17.47	-2.19	-8.17	-3.84	-7.31	-	0.66

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.0390	1.6730	1.9060	1.9490	2.2500	2.3600	2.4230	2.4820
涨跌幅 (BP)	16.80	0.80	-19.40	0.20	0.20	0.40	0.90	0.60

【公开市场】央行公开市场开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.00%。今日 710 亿元逆回购到期。

今日早盘资金面均衡偏松，大行国股有部分融出，隔夜押利率加权至加权+20bps 融出，押存单加权+30bps 不低 1.20%至+20bps 不低于 1.65%融出；7 天押利率加权融出，押存单、信用加权不低于 1.65%（限户）至 1.90%融出；14 天押利率加权至 2.20%融出，押地方 2.10%融出，押信用 2.20%融出；21 天-1M 融出较少，成交寥寥。午盘资金面持续均衡，隔夜-7 天融出报价较上午减少，押利率、存单 1.60%融出；7 天押存单、信用 1.80%融出；14 天-1M 融出报价较少，14 天非银押国股 2.05%、押信用 2.15%融出，成交寥寥。资金面呈均衡态势收盘。

今日全天的资金面指数：45-49-50-50

存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 23 日有 123 只同业存单发行，实际发行量 1188.9 亿，11 月 24 日将有 173 只存单计划发行，计划发行量为 2114.7 亿。

一级存单方面：今日 6M、9M 为工作日到期，1M、3M、1Y 为休息日到期，3M、6M、9M 期限交投活跃，其中 6M、9M 需求旺盛。具体来看，1M（休一）国股询在 1.65%，AAA 城农商询在 1.80%-2.00%；3M（休二）国股大行询在 2.15%-2.20%，AAA 城农商询在 2.30%-2.50%，部分城商行在 2.32%-2.45%位置有一定成交；6M 国股询在 2.35%，AAA 城农商询在 2.35%-2.62%，部分城农商在 2.48%-2.62%位置交投火爆，多家城农商募满；9M 国股大行询在 2.38%-2.48%，国股大行在 2.48%位置快速起量，募集到超 500 亿需求，AAA 城农商询在 2.40%-2.66%，部分城商行在 2.54%-2.62%位置有获得一定需求；1Y（休二）国股大行询在 2.40%-2.50%，AAA 城农商询在 2.45%-2.72%，部分城商行在 2.65%位置瞬间募满。(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 (%)	1.65	2.29	2.43	2.51	2.55
今日询价最高利率 (%)	1.65	2.20	2.35	2.48	2.50
涨跌幅 (BP)	0	-9	-8	-3	-5

二级存单交易方面：今日二级存单整体交投平稳，相比昨日收盘，各期限存单收益率均有所下行。

具体来看：11 月到期，国股大行成交在 1.20%-1.40%，AAA 大城农商少量成交在 1.35%-1.40%；12 月到期，国股大行成交在 1.80%-1.90%，AAA 大城农商成交在 1.85%-1.90%；明年 1 月到期，国股大行少量成交在 2.23%-2.25%，AAA 大城农商成交在 2.28%-2.30%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.25%-2.30%，AAA 大城农商成交在 2.30%-2.31%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.35%-2.40%，AAA 大城农商少量成交在 2.44%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.36%-2.415%，AAA 大城农商成交在 2.42%-2.46%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.45%-2.51%，AAA 大城农商成交在 2.53%-2.5875%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.46%-2.51%；AAA 大城农商成交在 2.52%-2.58%；明年 10-11 月到期，国股大行成交在 2.48%-2.54%，AAA 大城农商成交在 2.55%-2.60%。(Yuli Liao)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	1.85	2.25	2.36	2.46	2.49
	AAA (非国股)	1.90	2.30	2.43	2.52	2.55
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	-5	-5	-7	-9	-6.5
	AAA (非国股)	-3	-4	-3	-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短期限宽松，中长期限均衡，交投仍集中在 1M 内短期限，其他更长期限交投寥寥。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.77%-3.82%，成交集中在 3.79%-3.81%；1W 附近市场买盘报在 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 4.10%-4.20%，部分成交在 4.12%-4.15%；2M 市场少量买盘报 4.70%、3M 市场买盘报 5.06%-5.50%、6M 市场少量买盘报 5.24%、9M 市场少量买盘报 5.37%，1Y 市场少量买盘在 5.50%-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宽松，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 股份制询价报在 4.15%。

境外美元拆借市场：今日境外美金市场流动性整体显宽松，成交集中在 O/ N-3W 短期限，中长期限成交稀缺。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.77%-3.82%，成交集中在 3.77%-3.81%；1W 附近市场买盘报在 3.85%-3.90%，成交在 3.87%-3.90%；2W 市场少量买盘报 3.95%-4.03%，少量成交在 4.03%；1M 市场买盘报 4.10%-4.25%，成交寥寥；2M 市场买盘报 4.80%-4.85%、3M 市场买盘报在 5.30%-5.49%、6M 市场买盘报在 5.60%-5.78%，均无成交；9M 市场双边报价依旧冷清；1Y 市场少量买盘报 5.84%，暂无成交。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	3.78	3.80
1W	3.90	4.00
1M	4.15	4.30
3M	5.30	5.40
6M	5.30	5.40
1Y	5.45	5.55

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	3.01	3.29	4.34	4.83	5.13
EUR	1.49	1.71	2.57	3.04	3.30
AUD	2.86	3.06	3.98	4.33	4.66
YEN	-0.03	0.12	0.52	0.61	0.52
CNH	1.15	1.55	2.65	2.85	3.05
HKD	3.75	4.10	5.30	5.55	5.85

同业存放和非银存款参考报价

2022/11/23 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.7	1.3 ~ 1.15
2w	2.2 ~ 2.1	1.75 ~ 1.5
1m	2.3 ~ 1.95	1.87 ~ 1.5
3m	2.73 ~ 2.5	2.3~ 2.15
6m	2.92 ~ 2.6	2.43 ~ 2.0
1y	3.01 ~ 2.66	2.55 ~ 2.4

2022/11/23 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

2022/11/23 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	/	/

2022/11/23 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, Yuli Liao, 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评及更多资讯



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