



【2022-11-22】

人民币回购及NCD

货币市场

周二，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	DR3M	DR6M
加权利率 (%)	0.8705	1.6201	2.0301	2.0234	2.1000	2.1870	2.4660
涨跌幅 (BP)	-20.71	-2.15	3.12	-3.75	2.42	6.92	1.10

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	0.8710	1.6650	2.1000	1.9470	2.2480	2.3560	2.4140	2.4760
涨跌幅 (BP)	-26.80	-1.00	6.40	0.90	0.70	1.60	1.50	1.30

【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 1720 亿元逆回购到期。

今日资金面整体较宽松。具体来看：早盘国股大行有部分融出。隔夜押利率加权至+10bps 融出，押存单信用加权+20bps 至 1.80%融出。7 天押利率加权至 1.80%融出，押存单信用 1.80%至 1.90%融出。14 天押存单信用 2.15%至 2.25%融出，21 天至 1M 报价较少，融出寥寥。午后资金整体趋于均衡，隔夜至 7 天融出报价减少。隔夜押存单+20bps 至+25bps 融出，押信用 1.60%至 1.70%融出。资金面维持均衡至收盘。

今日全天的资金面指数：45-45-48-47

存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 22 日有 118 只同业存单发行，实际发行量 887.5 亿，11 月 23 日将有 128 只存单计划发行，计划发行量为 1326.1 亿。

一级存单方面：今日一级存单 3M、6M 和 1Y 部分名字募集较好。具体来看，1M（休二）部分国股在 1.80%募集到一定需求，AAA 城农商询在 1.80%-1.90%；3M 大行在 2.29%位置受买盘青睐，迅速募满，AAA 大农商在 2.36%成交，部分城商在 2.40%和 2.47%位置有少量需求；6M 部分国股在 2.42%-2.43%位置供不应求，AAA 部分城农商在 2.50%-2.53%位置有成交；9M 大行国股最高询在 2.51%，需求寥寥，AAA 部分城商在 2.55%和 2.60%位置有需求；1Y 大行国股在 2.55%位置募到不错需求，AAA 大城商成交在 2.60%，其他城农商在 2.65%-2.67%有成交。

(Coco Gao)

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	2.30	2.39	2.50	2.53
今日询价最高利率 (%)	1.65	2.29	2.43	2.51	2.55
涨跌幅 (BP)	0	-1	4	1	2

二级存单交易方面：今日二级存单整体交投平稳，较昨日收盘，年内存单收益率有所下行，明年 9-11 月存单收益率有所上行，其余期限存单收益率波动不大。

具体来看：11 月到期，国股大行成交在 1.35%-1.45%，AAA 大城农商成交在 1.40%-1.41%；12 月到期，国股大行成交在 1.85%-1.90%，AAA 大城农商成交在 1.90%-1.93%；明年 1 月到期，国股大行成交在 2.28%-2.30%，AAA 大城农商成交在 2.34%-2.35%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.26%-2.30%，AAA 大城农商成交在 2.30%-2.38%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.395%-2.42%，AAA 大城农商成交在 2.45%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.40%-2.45%，AAA 大城农商成交在 2.45%-2.46%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.50%-2.56%，AAA 大城农商成交在 2.55%-2.60%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.495%-2.56%；AAA 大城农商成交在 2.58%-2.60%；明年 10-11 月到期，

国股大行成交在 2.52%-2.56%，AAA 大城农商成交在 2.58%-2.605%。（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)	1.90	2.30	2.43	2.55	2.555
	AAA (非国股)	1.93	2.34	2.46	2.60	2.60
与昨日收益变动对照（BP）	AAA (国股)	-3	0	1	5	3.5
	AAA (非国股)	-2	1	-2	2	1

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，交投活跃在 1M 内短期限，3M 期限有少量成交，其他期限交投清淡。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.78%-3.82%，区间内有成交；1W 附近市场买盘报在 3.90%-4.00%，区间内均有成交；2W 市场买盘报在 4.00%-4.10%，部分成交在 4.00%-4.05%；1M 市场买盘报在 4.10%-4.20%，部分成交在 4.15%；2M 市场少量买盘报 4.70%，成交寥寥；3M 市场买盘报 5.04%-5.50%，少量成交在 5.50%；6M 市场少量买盘报 5.22%、9M 市场少量买盘报 5.35%，1Y 市场少量买盘在 5.48%-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宽松，少量交投在隔夜短期限，有 O/N 成交在 3.82%。

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短期限宽松，中长期限均衡，交投集中在 O/ N-1W 短期限，其他更长期限暂无成交。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.75%-3.81%，区间内均有成交；1W 附近市场买盘报在 3.78%-3.87%，成交在 3.87%；2W 市场少量买盘报 3.95%-4.00%，成交寥寥；1M 市场买盘报 4.00%-4.30%，成交稀缺；2M 市场买盘报 4.80%-4.85%、3M 市场买盘报在 5.40%-5.50%、6M 市场买盘报在 5.72%-5.73%，均无成交；9M 市场双边报价寥寥；1Y 市场少量买盘报 5.80%-5.84%，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	3.95
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	3.53	3.30	4.31	4.83	5.16
EUR	1.48	1.70	2.51	3.02	3.32
AUD	2.86	3.07	3.97	4.30	4.59
YEN	-0.05	0.11	0.48	0.59	0.52
CNH	1.15	1.70	2.85	2.95	3.15
HKD	3.85	3.95	5.30	5.55	5.85

同业存放和非银存款参考报价

2022/11/22 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	1.8 ~ 1.5
1m	2.3 ~ 1.95	1.9 ~ 1.5
3m	2.73 ~ 2.5	2.3~ 2.15
6m	2.92 ~ 2.6	2.42 ~ 2.0
1y	3.01 ~ 2.66	2.55 ~ 2.4

2022/11/22 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

2022/11/22 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	/	/

2022/11/22 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 / Coco Gao, Yuli Liao, 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:

以上所登及附加的所有信息（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