

收盘日评 银行间货币市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2022-05-23】

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	DR3M
加权利率 (%)	1.3214	1.5796	1.6980	1.6980	1.7702	1.9300	2.10
涨跌幅 (BP)	0.05	-0.43	0.99	0.47	-12.98	-3.90	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.3230	1.6930	1.7040	1.9000	2.0210	2.1670	2.2540	2.3310
涨跌幅 (BP)	0.10	2.80	0.30	-3.20	-2.90	-1.90	-0.70	-0.60

【公开市场】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，中国央行今日进行 100 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.1%，持平上次。今日有 100 亿元逆回购到期。

今日资金面全天整体持续均衡。开盘伊始，隔夜押利率债加权至加权+10bps 融出，押非利率债加权+20bps 至 1.70%融出。7 天银行押利率债 1.60%至 1.70%融出，非银 1.70%至 1.75%融出。14 天银行押利率债加权至 1.75%融出，非银 14 天 1.90%至 2.00%融出。21 天至 1M 银行融出报价较少，非银 21 天 2.00%融出，成交寥寥。资金面保持均衡态势直至午间收盘。下午延续均衡态势，价格较早盘变化不大。资金面呈现均衡态势直至收盘。（Shanshan Gu）

情绪指数：45-45-46-45

存单市场

截至下午 5 点 30 分，5 月 23 日有 64 只同业存单发行，实际发行量 284.6 亿，5 月 24 日将有 119 只存单计划发行，计划发行量为 1047.6 亿。

一级存单方面：今日 1M 和 9M 为休息日到期，其余为工作日到期，总体情绪一般，交投较清淡，6M 股份制募集情况相对好。具体来看，1M 国股询在 1.48%，AAA 城农商行询在 1.53%至 1.57%；3M 国股大行询在 1.70%，AAA 城农商行询在 1.73%至 1.88%；6M 国股询在 2.00%，股份制下午提价至 2.00%后起量迅速，很快募满截单，AAA 城农商行询在 1.98%至 2.04%；9M 国股询在 2.15%至 2.18%，AAA 城农商行询在 2.17%至 2.30%；1Y 国股大行询在 2.20%至 2.27%，AAA 城农商行询在 2.30%至 2.38%。（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
今日询价最高利率 (%)	1.48	1.70	2.00	2.18	2.27
昨日询价最高利率 (%)	1.48	1.70	1.95	2.15	2.26
涨跌幅 (BP)	0	0	5	3	1

二级存单交易方面：今日二级市场成交收益率与上周五基本持平，上周五卖盘较多，今日卖盘相对稳定。相对活跃期限为 6m、明年一季度到期及 4 月到期。具体来看：

5月到期，国股大行成交在1.40%，AAA大城农商成交寥寥；6月到期，国股大行成交在1.50%-1.53%，AAA大城农商成交在1.53%-1.55%；7月到期，国股大行成交在1.76%-1.80%，AAA大城农商成交在1.80%-1.81%；8月到期，国股大行成交在1.78%-1.82%，AAA大城农商成交在1.84%；9月到期，国股大行成交在1.78%-1.80%，AAA大城农商成交寥寥；10月到期，国股大行成交在1.97%-2.00%，AAA大城农商少量成交在2.00%；11-12月到期，国股大行成交在1.97%-2.00%，AAA大城农商成交在2.00%附近；明年1月到期，国股大行成交在2.16%-2.17%，AAA大城农商成交寥寥；明年2-3月到期，国股大行成交在2.17%-2.20%，AAA大城农商成交在2.19%-2.20%；明年4月到期，国股大行成交在2.27%-2.28%，AAA大城农商成交寥寥；明年5月到期，国股最高成交在2.28%，全天在2.27%-2.28%区间均有成交，AAA大城农商成交在2.30%-2.31%。（Zhiying Deng）

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	1.53	1.82	1.99	2.19	2.28
	AAA (非国股)	1.55	1.84	2.00	2.20	2.305
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	3	2	-1	1	0.5
	AAA (非国股)	5	3	-2	-3	0.5

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稍松，中长期稍紧，交投集中在隔夜期限，1W-1M和6M期限有部分成交，更长期限暂无成交。具体来看：隔夜市场成交集中在0.74%-0.76%，少量成交在0.77%；1W市场集中成交在0.79%-0.81%，价格与上一交易日相似；2W附近市场有部分成交在0.85%-0.90%，价格上行4BP左右；1M市场交投在1.03%-1.15%，价格无较大波动；2M市场双边报价仍稀缺，成交寥寥；3M市场买盘报在1.50%-1.62%，价格无明显波动，成交寥寥；6M市场少量买盘报1.80%-2.00%，少量成交在1.88%；9M-1Y长期市场交投情绪清淡。

境内美金回购市场：今日境内美金回购市场流动性稍松，少量交投在隔夜短期限，有O/N期限成交在0.74%。

境内美金存单市场：今日境内美金存单市场交投情绪稍显清淡，有1M城商行发行意向报在1.00%-1.05%；6M城商行发行意向报在1.95%-2.00%。

境外美元拆借市场：今日境外美金市场流动性隔夜期限稍松，其他期限偏紧，交投集中在O/N-1M期限，2M和1Y期限有少量成交，其他期限暂无成交。具体来看，O/N市场需求价格报在0.75%-0.80%，成交集中在0.75%-0.76%；1W需求价格报在0.80%-0.84%，部分成交在0.80%-0.82%，价格与上一交易日相似；2W市场买盘报在0.85%-0.95%，成交在0.87%-0.95%，价格小幅上行5BP左右；1M市场需求报在0.95%-1.05%，少量成交在0.98%-1.02%，价格无明显波动；2M市场需求报在1.37%-1.45%，价格同上一交易相似，成交在1.40%；3M市场需求报在1.60%-1.70%，价格上行5BP左右，成交寥寥；6M市场买盘报在2.20%-2.28%，卖盘寥寥，价格无较大波动；9M市场少量需求报2.40%-2.59%，暂无成交；1Y市场买盘报在2.78%-2.81%，偶有少量成交在2.81%。（Zhe Huang）

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	0.74	0.76
1W	0.77	0.80
1M	1.00	1.15
3M	1.55	1.65
6M	1.90	2.00
1Y	2.40	2.50

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	0.82	1.05	1.70	2.30	2.82
GBP	0.87	0.99	1.44	1.93	2.23
EUR	-0.63	-0.71	-0.30	0.13	0.41
AUD	0.26	0.48	1.51	2.02	2.60
YEN	-0.09	-0.20	-0.01	0.14	-0.02
CNH	1.95	2.45	2.75	2.85	3.15
HKD	0.04	0.155	0.875	1.675	2.55

同业存放和非银存款参考报价

2022/05/23 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	1.95 ~ 1.55	1.15 ~ 1.05
2w	2.15 ~ 1.65	1.4 ~ 1.3
1m	2.3 ~ 1.9	1.55 ~ 1.5
3m	2.7 ~ 2.25	1.95 ~ 1.7
6m	2.95 ~ 2.5	2.06 ~ 1.95
1y	3.05 ~ 2.68	2.36 ~ 2.2

2022/05/23 美金存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	0.4 ~ 0.1	L-10 ~ L-10
2w	0.5 ~ 0.15	L-10 ~ L-10
1m	0.6 ~ 0.25	L+10 ~ L-10
3m	0.7 ~ 0.35	L+10 ~ L-15
6m	0.8 ~ 0.5	L+0 ~ L-15
1y	1.3 ~ 0.95	L+20 ~ L-10

2022/05/23 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	/	/

2022/05/23 非银存款美金各期限双边价格

期限	融出	融入
1W	/	/
2W	/	/
1m	1.6 ~ 1.1	1 ~ 0.65
3m	1.75 ~ 1.2	1.15 ~ 0.75
6m	2.3 ~ 1.6	1.5 ~ 0.9
1y	2.55 ~ 1.7	1.65 ~ 1.15

文 / Shanshan Gu, Zhiying Deng, Zhe Huang, Zhanglan Yang

联系人: Rachael Yao
 邮箱: rachael.yao@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:
 以上所述及附加的所有信息(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,所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN