



【2022-11-07】

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 (%) | 1.6241 | 1.7403 | 1.6789 | 1.6609 | 1.6667 | 1.6499 | 2.0325 |
| 涨跌幅 (BP) | 23.4   | 10.32  | 8.32   | 9.45   | 4.11   | 2.86   | -      |

| 期限         | O/N   | 1W    | 2W    | 1M    | 3M    | 6M    | 9M    | 1Y    |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Shibor (%) | 1.620 | 1.786 | 1.695 | 1.677 | 1.769 | 1.891 | 1.997 | 2.049 |
| 涨跌幅 (BP)   | 23.4  | 8.4   | 6.7   | 0.2   | 1.5   | 0.7   | 0.8   | 0.6   |

【公开市场】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，今日开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.00%。今日 700 亿元逆回购到期。

今日资金面总体较为均衡，午盘有稍许收紧，临近尾盘转松。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，押存单加权+20bps 融出，押信用 1.65%融出。7 天押利率加权融出，押存单、信用 1.65%至 1.70%融出。14 天押存单、信用加权至 1.85%融出，21 天-1M 融出较少，成交寥寥。午后股份制无融出，隔夜-7 天融出报价较上午减少。隔夜押存单、信用+25bps 至 1.80%融出。临近尾盘略有转松，整体呈均衡收盘。

今日全天的资金面指数：51-57-52-49

存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 7 日有 107 只同业存单发行，实际发行量 466.2 亿，11 月 8 日将有 134 只存单计划发行，计划发行量为 701.1 亿。

一级存单方面：今日一级各期限均为工作日到期，交投清淡，成交弱。具体来看，1M 国股询在 1.35%，AAA 城农商行询在 1.50%至 1.67%，好资质城商行 1.65%有些许募集；3M 国股询在 1.86%至 1.88%，大行 1.86%有一定量成交，AAA 城农商行询在 1.92%至 2.05%；6M 国股询在 1.92%至 1.95%，AAA 城农商行询在 2.00%至 2.18%，多家城商报 2.10%至 2.13%，成交少量，个别城商 2.15%位置募得一定量需求；9M 大行国股询在 2.06%至 2.08%，AAA 城农商行询在 2.10%至 2.27%，成交寥寥；1Y 大行国股询在 2.02%至 2.08%，AAA 城农商行询在 2.17%至 2.35%，大城商 2.18%、普通城商 2.22%至 2.25%成交少量。(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 (%) | 1.40 | 1.82 | 1.94 | 2.06 | 2.08 |
| 今日询价最高利率 (%) | 1.35 | 1.88 | 1.95 | 2.08 | 2.08 |
| 涨跌幅 (BP)     | -5   | 6    | 1    | 2    | 0    |

二级存单交易方面：除年内到期外，今日二级存单收益率较周五均有所上行。

具体来看：11 月到期，国股大行成交在 1.45%-1.50%，AAA 大城农商成交在 1.50%-1.55%；12 月到期，国股大行成交在 1.45%-1.61%，AAA 大城农商成交在 1.60%-1.65%；明年 1 月到期，国股大行少量成交在 1.87%-1.90%，AAA 大城农商成交寥寥；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 1.91%-1.96%，AAA 大城农商成交再 1.96%-1.97%；明年 4 月到期，国股大行成交在 1.96%-2.00%，AAA 大城农商少量成交在 2.03%-2.04%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.02%-2.04%，AAA 大城农商少量成交在 2.05%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.09%-2.105%，AAA 大城农商成交在 2.13%-2.15%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.09%-2.115%；AAA 大城农商少量成交在 2.15%-2.16%；明年 10 月到期，国股大行成交在 2.10%-2.115%，AAA 大城农商成交在 2.17%，明年 11 月到期，国股大行成交在 2.10%-2.115%，AAA 大城农商暂无成交。

附：NCD 二级成交收益率

|               | 评级           | 1M   | 3M   | 6M   | 9M   | 1Y    |
|---------------|--------------|------|------|------|------|-------|
| 绝对收益率（%）      | AAA<br>(国股)  | 1.55 | 1.95 | 2.04 | 2.10 | 2.115 |
|               | AAA<br>(非国股) | 1.60 | 1.97 | 2.05 | 2.15 | 2.17  |
| 与昨日收益变动对照（BP） | AAA<br>(国股)  | 2    | 3    | 2    | 2    | 1.5   |
|               | AAA<br>(非国股) | -1   | 1    | 0    | 4    | 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隔夜期限较松，其他期限较紧，交投集中在隔夜和 1W 短期限，1M 期限有少量交投，更长期限交投清淡。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.78%-3.80%，区间内均有成交；1W 市场买盘报在 3.80%-3.95%，成交在 3.86%-3.95%；2W 市场少量买盘报在 3.92%-3.95%，成交寥寥；1M 市场买盘报在 4.05%-4.15%，部分成交在 4.05%；2M 市场少量买盘报 4.50%、3M 市场买盘报 4.78%-5.15%、6M 少量买盘报 4.99%、9M 少量买盘报 5.13%、1Y 少量买盘报 5.26%，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较松，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 城商行询价报在 4.10%。

**境外美元拆借市场：**今日境外美金市场流动性整体偏紧，交投集中在 O/N-1M 期限，3M 期限有少量成交，更长期限成交寥寥。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.75%-3.81%，成交集中在 3.79%-3.81%；1W 市场买盘报在 3.82%-3.90%，部分成交在 3.87%-3.90%；2W 市场买盘报 3.90%-4.00%，部分成交在 3.92%；1M 市场买盘报 3.95%-4.10%，部分成交在 4.05%；2M 市场买盘报 4.50%-4.60%，成交稀缺；3M 市场买盘价格报在 5.10%-5.30%，少量成交在 5.25%；长期限市场，6M 少量买盘报在 5.41%-5.57%、9M 少量买盘报在 5.60%-5.63%、1Y 少量卖盘报在 5.80%附近，均无成交。(Zhe 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  | 3.85 | 3.87 |
| 1M  | 3.95 | 4.05 |
| 3M  | 4.95 | 5.05 |
| 6M  | 4.90 | 5.10 |
| 1Y  | 5.20 | 5.30 |

附：境外各币种全期限拆借价格

| 币种  | 1W    | 1S   | 3S   | 6S   | 1Y   |
|-----|-------|------|------|------|------|
| USD | 3.85  | 4.10 | 5.30 | 5.60 | 5.80 |
| GBP | 2.94  | 3.16 | 4.06 | 4.52 | 4.90 |
| EUR | 1.42  | 1.62 | 2.33 | 2.77 | 3.13 |
| AUD | 2.71  | 3.03 | 3.93 | 4.11 | 4.50 |
| YEN | -0.18 | 0.06 | 0.41 | 0.43 | 0.29 |
| CNH | 1.55  | 1.65 | 2.65 | 2.85 | 3.05 |
| HKD | 2.25  | 3.05 | 4.75 | 5.05 | 5.45 |

同业存放和非银存款参考报价

2022/11/07 存放市场各期限双边价格

| 期限 | 融出          | 融入          |
|----|-------------|-------------|
| 1w | 1.85 ~ 1.5  | 1.44 ~ 1.25 |
| 2w | 2.2 ~ 1.6   | 1.45 ~ 1.3  |
| 1m | 2.3 ~ 1.9   | 1.7 ~ 1.45  |
| 3m | 2.73 ~ 2.24 | 2 ~ 1.8     |
| 6m | 2.92 ~ 2.5  | 2.15 ~ 1.95 |
| 1y | 3.01 ~ 2.66 | 2.22 ~ 1.9  |

2022/11/07 美金存放市场各期限双边价格

| 期限 | 融出          | 融入          |
|----|-------------|-------------|
| 1w | 3.75 ~ 3.55 | 3.5 ~ L-10  |
| 2w | 3.95 ~ 3.75 | 3.6 ~ 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 |

2022/11/07 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   | /           | /           |

2022/11/07 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, Scoot Zhang, Zhe 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报及更多资讯



免责声明:

以上所念及附加的所有信息(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