

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

【2022-11-16】

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
加权利率 (%)	1.9386	2.0150	2.0661	2.1162	2.0515	1.9700
涨跌幅 (BP)	8.93	7.21	10.24	17.63	7.04	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.9360	1.9980	2.0870	1.8840	2.1160	2.1640	2.2640	2.3490
涨跌幅 (BP)	8.30	6.90	11.80	5.30	10.70	12.10	11.10	12.50

【公开市场】央行公开市场开展 710 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%，今日 80 亿元逆回购到期。

今日早盘资金面均衡偏紧，隔夜报价较少，押存单信用加权+20bps 不低 2.00%至加权+40bps 融出；7 天押利率加权至 2.00%融出，押存单 2.10%不低加权至 2.20%融出。14 天至 1M 报价较少，融出寥寥。午盘资金面较上午收敛，隔夜押押存单信用加权+25bps 至 30 bps 融出。7 天非银 2.20%融出，三点后资金逐步宽松，隔夜报价增多，慢慢出现减点融出，资金面呈均衡偏松收盘。（Bella Wang）

今日全天的资金面指数：55-55-59-46

存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 16 日有 107 只同业存单发行，实际发行量 1425.8 亿，11 月 17 日将有 80 只存单计划发行，计划发行量为 387.4 亿。

一级存单方面：今日一级存单 6M、9M 为工作日到期，1M、3M、1Y 为休息日到期，具体来看，1M（休一）国股询在 1.90%，AAA 城农商询在 1.87%-2.05%，部分城商行在 2.00%有成交；3M（休二）国股大行询在 2.30%-2.40%，部分国股在 2.40%有少量需求，AAA 城农商询在 2.35%-2.50%，部分城农商在 2.42%-2.45%少量募集；6M 国股大行询在 2.38%-2.50%，部分国股在 2.50%有一定成交，AAA 城农商询在 2.42%-2.53%；9M 国股大行询在 2.45%-2.52%，部分国股大行在 2.52%有需求，AAA 城农商询在 2.47%-2.60%；1Y（休二）国股大行询在 2.45%-2.50%，AAA 城农商询在 2.50%-2.65%。

今日受多个到期日为休息日影响，全天整体交投清淡。（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 (%)	/	2.33	2.40	2.46	2.51
今日询价最高利率 (%)	1.90	2.40	2.50	2.52	2.50
涨跌幅 (BP)	/	7	10	6	-1

二级存单交易方面：各期限成交收益率均有大幅上行，1Y 期限成交收益率较昨日收盘上行 15bp 左右。具体来看：11 月到期，国股大行成交在 1.70%-1.80%，AAA 大城农商成交在 1.75%-1.80%；12 月到期，国股大行成交在 1.85%-2.00%，AAA 大城农商成交在 1.90%-2.02%；明年 1 月到期，国股大行成交在 2.30%-2.55%，AAA 大城农商成交在 2.50%附近；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.35%-2.60%，AAA 大城农商成交在 2.50%-2.65%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.45%-2.61%，AAA 大城农商成交在 2.50%附近；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.46%-2.65%，AAA 大城农商成交在 2.55%-2.70%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.49%-2.68%，AAA 大城农商成交在 2.53%-2.73%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.49%-2.67%；AAA 大城农商成交在 2.56%-2.75%；明年 10-11 月到期，早盘国股大行成交在 2.50%-2.58%，随后一路上行，尾盘成交在 2.65%-2.67%，全天最高上行 16bp 左右，AAA 大城农商少量成交在 2.55%-2.73%。(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)	2.00	2.58	2.62	2.65	2.66
	AAA (非国股)	2.03	2.60	2.65	2.68	2.70
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	15	21	17	16	15
	AAA (非国股)	13	21	17	16	15

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，其他期限偏紧，成交集中在隔夜期限，1W 和 2W 附近期限有部分交投，其他期限交投清淡。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.79%-3.83%，区间内均有成交；1W 市场买盘报在 3.90%-3.95%，成交在 3.91%-3.95%；2W 附近市场买盘报在 3.88%-4.12%，部分成交在 3.98%-4.05%；1M 市场买盘报在 4.07%-4.15%，成交寥寥；2M 市场买盘报 4.65%-4.75%、3M 市场买盘报 4.94%-5.45%、6M 市场少量买盘报 5.14%、9M 市场少量买盘报 5.29%，暂无成交；1Y 市场少量买盘在 5.42%-5.60%，少量卖盘报 5.80%-5.85%。

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 3.82%。

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隔夜期限较松，中长期期限均衡偏紧，交投集中在 O/N-1M 期限，6M 期限有少量成交。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.77%-3.83%，成交集中在 3.80%-3.83%；1W 市场买盘报在 3.84%-3.92%，少量成交在 3.92%；2W 市场买盘报 3.95%-4.05%，少量成交在 4.05%；3W 市场少量交投在 4.00%；1M 市场买盘报 4.05%-4.20%，部分成交在 4.15%-4.17%；2M 市场买盘报 4.65%-4.80%，卖盘稀缺；3M 市场少量买盘报在 5.40%-5.44%，成交寥寥；6M 市场少量交投在 5.88%；9M 市场双边报价稀缺；1Y 市场尾盘少量需求报 5.80%，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	3.79	3.83
1W	3.87	3.93
1M	4.05	4.15
3M	5.25	5.35
6M	5.40	5.50
1Y	5.55	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	4.20	5.55	5.80	5.90
GBP	3.04	3.31	4.45	4.89	5.19
EUR	1.46	1.65	2.65	3.09	3.38
AUD	2.89	3.16	4.13	4.40	4.72
YEN	-0.08	0.08	0.60	0.66	0.57
CNH	1.15	1.55	2.75	3.05	3.25
HKD	3.15	3.15	5.05	5.25	5.65

同业存放和非银存款参考报价

2022/11/16 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 ~ 2.1	2.05 ~ 1.5
1m	2.3 ~ 1.95	1.92 ~ 1.5
3m	2.73 ~ 2.5	2.43~ 1.95
6m	2.92 ~ 2.6	2.55 ~ 2
1y	3.01 ~ 2.66	2.6 ~ 2.05

2022/11/16 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

2022/11/16 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	/	/

2022/11/16 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

联系人: Raehoel Yoo
邮箱: raehoel.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:
以上所查及增加的所有信息 (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