

# 收盘日评 银行间货币市场

常规报告系列

15<sup>th</sup>  
CFETS-NEX  
上海国际货币经纪15周年  
CFETS-NEX 15th Anniversary 2007-2022

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

【2022-11-08】

## 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
加权利率 (%)	1.7458	1.8193	1.7575	1.7446	1.6739
涨跌幅 (BP)	12.17	7.90	7.86	8.37	0.72

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.7560	1.8120	1.7530	1.6880	1.7810	1.8960	2.0020	2.0540
涨跌幅 (BP)	13.60	2.60	5.80	1.10	1.20	0.50	0.50	0.50

【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 150 亿元逆回购到期。

今日资金面总体较为均衡，日间边际收紧，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、信用加权+25bps 至+30bps 或不低于 1.80%至 2.00%融出。7 天押利率加权至+10bps 融出，押存单、信用 1.85%至 1.90%融出。14 天押利率 1.70%至 1.75%融出，押存单、信用 1.95%融出，21 天-1M 融出较少，成交寥寥。随后资金面维持收紧态势，隔夜押利率国股至 2.20%融出，7 天 2.05%至 2.10%融出。临近尾盘资金面转松，隔夜出现减点融出，维持宽松直至收盘。

今日全天的资金面指数：55-55-54-45

存单市场

### 存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 8 日有 124 只同业存单发行，实际发行量 503.7 亿，11 月 9 日将有 127 只存单计划发行，计划发行量为 1046 亿。一级存单方面：今天一级存单除 1M 是休二到期外，其他期限为工作日到期，上午交投清淡，下午资金面转松后交投回暖。具体来看，1M (休二) 国股询在 1.35%，AAA 城农商询在 1.60%-1.67%；3M 大行在 1.88%位置、国股在 2.00%位置募集到量，AAA 大城商在 2.05%位置募集火热，其他名字在 2.05%-2.06%也有部分成交；6M 国股询在 1.95%-1.98%，AAA 城农商询在 2.05%-2.20%，需求寥寥；9M 大行国股询在 2.05%，AAA 部分农商在 2.25%位置需求较好；1Y 大行国股最高询在 2.15%，有一定需求，AAA 大城农商在 2.25%需求火爆，其他部分城农商在 2.26%-2.30%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 (%)	1.35	1.88	1.95	2.08	2.08
今日询价最高利率 (%)	1.35	2.00	1.98	2.05	2.15
涨跌幅 (BP)	0	12	3	-3	7

二级存单交易方面：今日二级存单收益率较昨日有明显上行。

具体来看：11 月到期，国股大行成交在 1.50%-1.75%，AAA 大城农商成交在 1.65%-1.80%；12 月到期，国股大行成交在 1.53%-1.70%，AAA 大城农商成交在 1.65%-1.70%；明年 1 月到期，国股大行少量成交在 1.90%-1.97%，AAA 大城农商暂无成交；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 1.93%-2.04%，AAA 大城农商成交再 2.00%-2.04%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.00%-2.08%，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 2.05%-2.115%，AAA 大城农商少量成交在 2.12-2.13%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.10%-2.17%，AAA 大城农商成交在 2.18%-2.22%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.12%-2.17%；AAA 大城农商成交较少；明年 10 月到期，国股大行成交在 2.13%-2.17%；明年 11 月到期，国股大行成交在 2.15%-2.17%，AAA 大城农商少量成交在 2.20%。(Scoot Zhang)

### 附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	1.65	2.01	2.08	2.1325	2.16
	AAA (非国股)	1.70	2.03	2.10	2.18	2.20
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	10	6	4	3.25	4.5
	AAA (非国股)	10	6	5	3	3

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整体有所收紧, 交投集中在隔夜和 1W 短期限, 中长期限交投清淡。具体来看: O/N 市场全天成交在 3.78%-3.81%, 自早盘收紧后价格上行至 3.81% 仍供不应求; 1W 市场买盘报在 3.83%-3.95%, 成交在 3.86%-3.95%; 2W 市场买盘报在 3.92%-3.95%, 暂无融出; 1M 市场买盘报在 4.05%-4.15%, 交投清淡; 2M 市场买盘少量报 4.50%、3M 市场买盘报 4.81%-5.15%、6M 少量买盘报 5.01%、9M 少量买盘报 5.15%、1Y 部分买盘报 5.29-5.60%, 暂无融出。

**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, 成交集中在 O/N-1M 期限, 3M 期限有部分成交, 更长期限交投清淡。具体来看, O/N 市场买盘报在 3.76%-3.82%, 成交集中在 3.80%-3.81%; 1W 市场买盘报在 3.82%-3.87%; 2W 市场买盘报 3.88%-3.92%; 1M 市场买盘报 3.97%-4.10%, 融出意向报 4.05%-4.06%, 成交在 4.05%; 2M 市场买盘报 4.55%-4.65%, 融出寥寥; 3M 市场买盘价格报在 5.14%-5.35%, 少量成交在 5.30%; 长期限市场, 6M 买盘报在 5.45%-5.70%、9M 少量买盘报在 5.66%、1Y 少量卖盘报在 5.75-5.80%, 暂无成交。(Will Wang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	3.78	3.81
1W	3.86	3.90
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	2.93	3.10	4.00	4.47	4.84
EUR	1.42	1.44	2.31	2.76	3.13
AUD	2.77	2.98	3.85	4.15	4.57
YEN	-0.18	0.06	0.40	0.40	0.28
CNH	1.30	1.55	2.55	2.75	2.95
HKD	2.05	3.00	4.75	5.05	5.45

同业存放和非银存款参考报价

☒

2022/11/08 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	1.85 ~ 1.6	1.55 ~ 1.25
2w	2.2 ~ 1.6	1.55 ~ 1.3
1m	2.3 ~ 1.95	1.9 ~ 1.5
3m	2.73 ~ 2.24	2.1 ~ 1.85
6m	2.92 ~ 2.5	2.18 ~ 1.95
1y	3.01 ~ 2.66	2.26 ~ 1.9

2022/11/08 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	3.95 ~ L-10
1m	4.05 ~ 3.95	4.1 ~ 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

2022/11/08 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	/	/

2022/11/08 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, Will Wang, 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:**  
 以上所发及列加的所有信息(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