



【2022-05-30】

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	DR4M
加权利率（%）	1.3939	1.7849	1.7626	1.7679	1.6800	1.8000	2.2500
涨跌幅（BP）	1.89	7.56	3.04	6.94	-	7.75	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor（%）	1.405	1.814	1.803	1.856	1.997	2.126	2.236	2.319
涨跌幅（BP）	2.4	3.7	6.5	0.2	0.20	-0.4	-0.3	-0.4

【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，隔夜押利率债加权融出，押非利率债加权+15bps 至 1.75%融出。7 天跨月期限押利率债、存单、信用 1.90%至 1.95%融出。14 天银行押利率加权融出，非银 14 天 1.85%融出。21 天至 1M 银行融出报价较少，成交寥寥。资金面保持均衡态势直至午间收盘。下午资金价格较早盘变化不大, 整体延续均衡态势直至收盘。

全天资金面情绪指数：45-43-46-45



存单市场

截至下午 5 点 30 分，5 月 30 日有 76 只同业存单发行，实际发行量 895.4 亿，5 月 31 日将有 35 只存单计划发行，计划发行量为 196.6 亿。一级存单方面：一级存单方面，今日各期限均为工作日到期，总体交投清淡。具体来看，1M 国股询在 1.60%，AAA 城农商行询在 1.62%至 1.70%，1.70%城商行有成交；3M 国股大行询在 1.70%，AAA 城农商行询在 1.75%至 1.85%；6M 国股询在 1.95%，AAA 城农商行询在 1.95%至 2.07%；9M 国股询在 2.15%，AAA 城农商行询在 2.19%至 2.30%；1Y 国股大行询在 2.25%至 2.28%，大行提价 2.28%后募集到一定量需求，AAA 城农商行询在 2.28%至 2.40%。（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（%）	1.60	1.70	1.95	2.15	2.28
昨日询价最高利率（%）	1.48	1.70	1.95	2.15	2.29
涨跌幅（BP）	12	0	0	0	-1

二级存单交易方面：各期限成交收益率较前一交易日基本持平，三季度到期和明年一二季度到期期限交投相对活跃。具体来看：6 月到期，国股大行成交在 1.40%-1.52%，AAA 大城农商成交在 1.47%-1.55%；7 月到期，国股大行成交在 1.65%-1.82%，AAA 大城农商成交在 1.80%-1.84%；8 月到期，国股大行成交在 1.80%-1.83%，AAA 大城农商少量成交在 1.85%附近；9 月到期，国股大行成交在 1.80%-1.83%，AAA 大城农商成交寥寥；10 月到期，国股大行成交在 1.95%-1.99%，AAA 大城农商少量成交在 2.00%附近；11-12 月到期，国股大行成交在 1.98%-2.00%，AAA 大城农商成交在 2.00%-2.03%；明年 1 月到期，国股大行成交在 2.10%-2.15%，AAA 大城农商成交在 2.13%附近；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.20%-2.23%附近；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.26%-2.285%，AAA 大城农商成交在 2.30%-2.32%；明年 5 月到期，国股成交在 2.275%-2.31%-2.33%。（Honghe 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）	1.50	1.82	1.99	2.19	2.285
	AAA（非国股）	1.55	1.85	2.01	2.21	2.31
与昨日收益变动对照（BP）	AAA（国股）	0	0	1	-1	0
	AAA（非国股）	0	1	1	0	0

外币拆借市场

境内美元拆借市场：今日是美金假期，境内美金市场流动性整体均衡偏松，有部分交投在 T/N、1W、1M 和 3M 期限，其他期限暂无成交。具体来看：T/N 市场成交在 0.75%，价格无明显波动；1W 市场集中成交在 0.80%-0.86%；2W 市场报价稀缺，交投清淡；1M 市场少量交投在

1.05%-1.26%，价格与上一交易日相似；2M 市场双边报价稀缺，成交寥寥；3M 市场少量成交在 1.76%-1.83%，价格无明显波动；6M 市场少量买盘报在 1.80%-1.96%，卖盘寥寥；9M-1Y 长期限市场交投清淡。

境内美金回购市场：今日是美金假期，境内美金回购市场流动性均衡，交投情绪清淡，暂无成交。

境内美金存单市场：今日是美金假期，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 1.05%；6M 城商行发行意向报在 2.05%。

境外美元拆借市场：今日是美金假期，境外美金市场流动性短期限均衡，中长期限稍紧，交投集中在 1M 内期限，其他长期限卖盘稀缺，成交寥寥。具体来看，T/N 市场需求价格报在 0.76%-0.78%，区间内有成交，价格与上一交易日相似；1W 需求价格报在 0.78%-0.88%，少量成交在 0.82%-0.88%，价格无明显波动；2W 市场买盘报在 0.85%-0.93%，暂无成交；1M 市场需求报在 1.10%-1.25%，少量成交在 1.12%；2M 市场少量需求报在 1.49%，卖盘清淡；3M 市场需求报在 1.65%-1.72%、6M 市场少量需求报在 2.25%、9M 少量需求报在 2.50%、1Y 市场今日需求寥寥，价格均无较大波动，暂无成交。(Zhe Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
T/N	0.70	0.76
1W	0.77	0.80
1M	1.00	1.15
3M	1.60	1.70
6M	2.00	2.10
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	0.85	1.13	1.70	2.25	2.75
GBP	0.92	1.05	1.08	1.67	2.20
EUR	-0.62	-0.50	-0.37	-0.06	0.31
AUD	0.31	0.50	0.83	1.69	2.66
YEN	-0.22	-0.14	-0.13	-0.08	-0.05
CNH	2.30	2.25	2.45	2.65	3.05
HKD	0.055	0.20	0.80	1.60	2.45

同业存放和非银存款参考报价

2022/05/30 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	1.95 ~ 1.55	1.45 ~ 1.25
2w	2.15 ~ 1.65	1.45 ~ 1.35
1m	2.3 ~ 2	1.9 ~ 1.5
3m	2.7 ~ 2.25	1.95 ~ 1.75
6m	2.95 ~ 2.5	2.05 ~ 2
1y	3.05 ~ 2.68	2.38 ~ 2.25

2022/05/30 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

2022/05/30 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	/	/

2022/05/30 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, Honghe Meng, 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:

以上所含及附加的所有信息（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