

# 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

【2022-11-21】

## 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	DR6M
加权利率 (%)	1.0776	1.6416	1.9989	2.0609	2.0758	2.3000	2.1178	2.4550
涨跌幅 (BP)	-24.19	-7.97	-4.08	-9.54	-2.02	15.00	-8.22	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.1390	1.6750	2.0360	1.9380	2.2410	2.3400	2.3990	2.4630
涨跌幅 (BP)	-22.50	-11.60	-0.10	0.50	0.30	2.90	1.50	1.40

【公开市场】央行公开市场开展 30 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.00%。今日 50 亿元逆回购到期。

今日早盘资金面均衡，国股大行均有融出，隔夜押利率加权融出，押存单加权+30bps 不低 1.80%融出；7 天押利率存单 1.80%至 1.90%融出，14 天押存单 2.30%至 2.35%融出，1M 押存单 2.20%融出。午盘资金面持续均衡宽松，隔夜加权+10bps 至 30 bps 融出。7 天押利率存单 1.60%-1.90%融出，14 天押存单信用 2.10%-2.35%，21 天-1M 报价较少，需求寥寥。资金面呈均衡偏松态势收盘。

今日全天的资金面指数：45-45-47-46

### 存单市场

截至下午 5 点 30 分，11 月 21 日有 116 只同业存单发行，实际发行量 1317.8 亿，11 月 22 日将有 124 只存单计划发行，计划发行量为 1054.5 亿。

一级存单方面：今日各期限均为工作日到期，1M、3M、6M、1Y 均有一定成交，其中 6M 和 1Y 交投较为活跃。具体来看，1M 国股大行在 1.65%，AAA 城农商行在 1.80%至 1.92%，好资质城商行 1.85%和 1.90%位置均有募满；3M 国股大行在 2.20%至 2.30%，股份制 2.30%需求旺盛，AAA 城农商行在 2.30%至 2.50%，其中部分城商行在 2.33%-2.50%位置均有一定需求，有城商行在 2.45%位置募满；6M 国股大行在 2.35%至 2.39%，股份制 2.39%有部分成交，AAA 城农商行在 2.35%至 2.57%，部分机构 2.48%至 2.50%及 2.55%位置募满；9M 大行国股大行在 2.45%至 2.50%，AAA 城农商行在 2.40%至 2.62%；1Y 国股大行在 2.40%至 2.53%，大行、股份制在 2.52%-2.53%位置募集到部分需求，AAA 城农商行在 2.45%至 2.70%，部分城商行在 2.62%-2.70%位置有一定募集。(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 (%)	1.65	2.30	2.39	2.45	2.47
今日询价最高利率 (%)	1.65	2.30	2.39	2.50	2.53
涨跌幅 (BP)	0	0	0	5	6

二级存单交易方面：今日二级存单交投平稳，较上周五收盘，各期限存单收益率均有一定幅度下行。

具体来看：11 月到期，国股大行成交在 1.40%-1.50%，AAA 大城农商成交在 1.50%；12 月到期，国股大行成交在 1.84%-1.95%，AAA 大城农商成交在 1.85%-1.95%；明年 1 月到期，国股大行成交在 2.24%-2.29%，AAA 大城农商成交在 2.35%；明年 2-3 月到期，国股大行成交在 2.27%-2.34%，AAA 大城农商成交在 2.30%-2.39%；明年 4 月到期，国股大行成交在 2.38%-2.42%，AAA 大城农商成交在 2.42%-2.45%；明年 5-6 月到期，国股大行成交在 2.39%-2.45%，AAA 大城农商成交在 2.43%-2.50%；明年 7-8 月到期，国股大行成交在 2.45%-2.53%，AAA 大城农商成交在 2.53%-2.59%；明年 9 月到期，国股大行成交在 2.45%-2.53%；AAA 大城农商成交在 2.53%-2.59%；明年 10-11 月到期，国股大行

成交在 2.46%-2.53%，AAA 大城农商成交在 2.54%-2.59%。(Yuli Liao)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	1.93	2.30	2.42	2.50	2.52
	AAA (非国股)	1.95	2.33	2.48	2.58	2.59
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	-7	-5	-5	-3	-2
	AAA (非国股)	-7	-5	-2	2	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短期限宽松，中长期均衡，成交集中在 1M 内期限，3M 及更长期限交投清淡。具体来看：O/N 市场买盘报在 3.79%-3.82%，区间内有成交；1W 市场买盘报在 3.92%-3.98%，区间内有成交；2W 市场买盘报在 3.85%-4.12%，成交在 3.95%-4.10%；1M 市场买盘报在 4.00%-4.20%，部分成交在 4.10%-4.15%；2M 市场少量买盘报 4.70%、3M 市场买盘报 5.02%-5.50%、6M 市场少量买盘报 5.20%、9M 市场少量买盘报 5.34%，1Y 少量买盘在 5.48%，均无成交。

**境内美金回购市场：**今日境内美金回购市场流动性宽松，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短期限宽松，中长期均衡，交投集中在 O/ N-1W 附近短期限，3W、1M 和 2M 期限有部分成交，其他期限暂无成交。具体来看，O/N 市场买盘报在 3.77%-3.82%，区间内均有成交；1W 附近市场买盘报在 3.80%-3.95%，成交在 3.85%-3.95%；2W 市场少量买盘报 3.95%-4.00%，少量卖盘报 4.05%；3W 市场部分交投在 4.10%；1M 市场买盘报 4.10%-4.30%，成交在 4.25%-4.30%；2M 市场买盘报 4.70%-4.92%，少量成交在 3.92%；3M 市场买盘报在 5.35%-5.45%、6M 市场买盘报在 5.60%-5.70%，均无成交；9M 市场双边报价寥寥；1Y 市场少量买盘报 5.80%，鲜有成交。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	3.80	3.83
1W	3.90	3.95
1M	4.15	4.30
3M	5.30	5.40
6M	5.35	5.45
1Y	5.45	5.60

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	5.40	5.75	5.85
GBP	2.96	3.18	3.82	4.33	5.03
EUR	1.48	1.53	2.65	3.05	3.32
AUD	2.78	2.99	3.48	3.80	4.40
YEN	-0.08	0.00	0.14	0.16	0.27
CNH	1.15	1.60	2.85	3.05	3.25
HKD	3.75	3.75	5.30	5.40	5.65

同业存放和非银存款参考报价

2022/11/21 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.05 ~ 1.7	1.3 ~ 1.2
2w	2.2 ~ 2.1	1.8 ~ 1.5
1m	2.3 ~ 1.95	1.9 ~ 1.5
3m	2.73 ~ 2.5	2.35 ~ 2.2
6m	2.92 ~ 2.6	2.42 ~ 2.0
1y	3.01 ~ 2.66	2.52 ~ 2.4

2022/11/21 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

2022/11/21 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	/	/

2022/11/21 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 / Bella Wang, Yuli Liao, Allen Huang, Zhanglan Yang

联系人: Raohel Yao  
 邮箱: raohel.yao@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:**  
 以上所发及附加的所有信息 (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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)