



同业存单周报：同业存单发行利率整体上行



最近市场情况

发行达成率: 1.按评级来看,十一月第二周 AAA、AA+、AA、AA-级存单发行成功率分别为 85%、53%、56%、65%。各级存单发行达成率较上周均有所下降。2.按银行来看,股份行、城商行和农商行存单发行达成率分别为 84%、71%、85%。股份行、城商行、农商行存单发行达成率较上周均有所下降。

信用利差: 1.按评级来看,十一月第二周 3 月期同业存单 AAA-、AA+、AA、AA-、A+、A、A-级存单信用利差分别为 1.09bps、6bps、12bps、40bps、73bps、109bps、144bps。2.按银行来看,城商行、农商行发行存单信用利差分别为 31bps、23bps。

发行市场概况

同业存单各期限发行利率: 1 个月 2.39%, 3 个月 2.74%, 6 个月 2.89%。

相较于上周, 1 个月、3 个月、6 个月期存单发行利率均有上升, 涨幅分别为 +3bps、+1bps、+2bps。

不同银行类别发行利率: 十一月第二周, 各类型银行同业存单发行利率涨跌不一: 城商行 9 个月期同业存单发行利率涨幅 (+15bps) 居前、农商行 1 年期同业存单发行利率跌幅 (-10bps) 居前。

发行数量: 十一月第二周发行同业存单 861 款, 融资 6,593 亿元, 发行规模较上周下降。截至 2021 年 11 月 12 日, 存量同业存单 16,713 款,

共计 134,592 亿元。

发行期限结构：与前一周相比，十一月第二周，3 个月、6 个月、9 个月期同业存单发行占比上升，1 个月、1 年期同业存单发行占比下降。

发行主体结构：与前一周相比，十一月第二周发行同业存单的商业银行中，股份行、城商行、农商行发行占比上升，国有商行发行占比下降。

发行银行：十一月第二周，民生银行发行同业存单 563 亿元占据首位，江苏银行发行 222 亿元排名第二。

同业存单持有人概况

持有人结构：截至 2021 年 10 月底，在上海清算所托管的存单总额为 131,530 亿元，较上月上升。其中，广义基金持有 74,245 亿元，占比 56.4%，较上月上升；商业银行持有 45,858 亿元，占比 34.9%，较上月下降；非银机构及其他持有 11,427 亿元，占比 8.7%，较上月上升。

银行持有概况：农商行持有存单 20,202 亿元，占比 44.1%，较上月下降；国有商业银行持有存单 8,014 亿元，占比 17.5%，较上月下降；城

预览已结束，完整报告链接和二维码如下：

https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1_29416

