

收盘日评
银行间货币市场

常规报告系列



【2023-04-23】

人民币回购及NCD

货币市场

周日，质押式回购存款类机构加权价格如下：

品种	DR001	DR007	DR014	DR021
加权利率(%)	1.7399	2.1688	2.4234	2.4667
涨跌幅(BP)	-53.40	-9.82	-3.23	5.91

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor(%)	1.8060	2.0960	2.4010	2.3120	2.4290	2.5070	2.5900	2.6490
涨跌(BP)	-46.60	-10.30	-1.10	0.20	-	-	0.10	-

【公开市场操作】央行公开市场开展 890 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%。Wind 数据显示，今日无逆回购到期。

今日资金面整体均衡偏宽松。早盘大行股份制有部分融出。隔夜押利率在加权至+15bps 融出，押存单信用加权至+20bps 融出。 7 天押利率主要在加权至 2.50%融出。14 天押利率在加权至 2.45%融出，押存单信用在加权至 2.60%融出。21 天-1M 融出报价较少，成交寥寥。早盘整体维持偏松态势至午间收盘。午后资金面仍维持偏宽松态势，隔夜押利率加权融出，押存单信用加权附近至 1.95%融出，7 天及以上期限报价较少，成交寥寥，整体维持均衡偏松态势至收盘。

今日全天的资金面情绪指数：[48-45-46-45](#)

存单市场

今日一级存单均为工作日到期，3M 交投较为火热。具体来看，1M 国股询在 2.10%-2.15%，AAA 城农商询在 2.20%-2.35%；3M 国股大行询在 2.38-2.43%，并在 2.43%位置获得较好募集需求；AAA 城农商询在 2.43%-2.52%；6M 大行国股询在 2.45%，AAA 城农商询在 2.52%-2.62%；9M 大行国股询在 2.45%-2.57%，AAA 城农商询在 2.62%-2.70%；1Y 大行国股询在 2.60%-2.63%， AAA 城农商询在 2.66%-2.75%。(Kurt Du)

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 (%)	2.15	2.38	2.48	2.58	2.64
今日询价最高利率 (%)	2.15	2.43	2.45	2.57	2.63
涨跌幅 (BP)	0	5	-3	-1	-1

二级存单交易方面：今日二级成交较为清淡，与周五尾盘相比，各期限存单收益率均有所下行。

具体来看：二季度到期，主要买盘为银行，4 月到期国股大行成交在 1.85%-1.90%，AAA 大城农商成交在 1.95%-2.00%，5 月到期国股大行成交在 2.32%-2.34%，AAA 大城农商成交在 2.34%左右，6 月到期国股大行成交在 2.33%左右，AAA 大城农商成交在 2.34%；三季度到期，主要买盘为理财，7 月到期国股大行成交在 2.405%-2.44%，AAA 大城农商成交在 2.46%；8 月-9 月到期国股大行成交在 2.43%-2.44%，AAA 大城农商暂无成交；四季度到期，主要买盘为农商，10 月-12 月到期国股大行成交在 2.49%左右，AAA 大城农商暂无成交；明年一季度到期，主要买盘为农商，明年 1 月到期成交在 2.59%左右，明年 2 月-3 月到期国股大行成交在 2.61%左右，AAA 大城农商成交在 2.64%-2.67%；明年 4 月到期，主要买盘为农商，国股大行成交在 2.63%-2.64%，AAA 大城农商主要成交在 2.68%-2.69%。(Jenny Chen)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	2.34	2.44	2.49	2.59	2.64
	AAA (非国股)	2.34	2.46	2.53	2.64	2.68
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	-2	0	-2	1	0
	AAA (非国股)	-4	-1	-1	2	0

2023/04/23 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.50~ 1.90	2.05~ 1.70
2w	2.65~ 1.98	2.25~ 1.80
1m	2.70~ 2.30	2.20~ 2.05
3m	2.88~ 2.58	2.46~ 2.38
6m	2.90~ 2.70	2.58~ 2.40
1y	3.00~ 2.85	2.70~ 2.60

2023/04/23 非银存款各期限双边价格

期限	融出	融入
1m		
3m		
6m		
1y	3.70~3.00	3.50~2.60
3Y	3.75~3.50	3.50~3.25
5Y	4.20~3.75	4.00~3.50

文/Kurt Du, Jenny Chen, Yu Qiu

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评及更多资讯



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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息