

# 收盘日评 银行间货币市场

常规报告系列

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

【2023-03-02】

## 人民币回购及NCD

### 货币市场

周四，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 (%)	1.5863	1.9972	1.9624	2.0090	2.3205	2.3937	2.6000	2.5700
涨跌幅 (BP)	-47.47	-9.15	-13.64	-9.90	16.70	-0.14	-	-1

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.62	1.933	1.956	2.294	2.459	2.567	2.642	2.718
涨跌幅 (BP)	-46.7	-9.7	-14.8	0	0.9	0.8	0.6	0.7

【公开市场】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，央行今日开展7天期730亿元逆回购操作，中标利率为2.00%，与此前持平。今日有3000亿元7天期逆回购到期，当日实现净回笼2270亿元。

今日早盘资金面均衡，大行股份制有大量融出。隔夜押利率加权+10bps至加权+20bps融出，押存单信用加权+20bps至加权+30bps融出；7天押利率2.20%至加权+5bps融出，押存单信用2.25%至2.40%融出；14天押存单信用2.45%至2.50%融出，21天至1M融出较少，成交寥寥；中午过后资金面逐渐宽松，隔夜加权减点至加权融出大量成交，直至收盘。(Yilun Ma)

今日全天的资金面情绪指数：48-46-45-46

### 存单市场

截至下午5点30分，3月2日有100只同业存单发行，实际发行量244.9亿，3月3日将有193只存单计划发行，计划发行量2395.4亿。

今日一级存单各期限均为工作日到期，1Y国股大行交投较活跃。具体来看，1M国股大行在2.15%-2.40%，大行在2.40%位置募得部分需求，AAA城农商在2.40%-2.55%，个别大城商在2.50%位置获得部分交投；3M国股大行在2.48%-2.50%，AAA城农商在2.53%-2.63%，部分农商行在2.58%-2.60%位置获得较好需求，提前募满；6M大行国股在2.60%-2.62%，部分大行在2.62%募得较好需求，AAA城农商在2.58%-2.72%，部分城农商行在2.68%-2.72%位置交投火爆，提前募满；9M大行国股在2.62%-2.68%，股份制在2.68%位置获得部分需求，AAA城农商在2.68%-2.76%；1Y大行国股在2.75%，国股大行在2.75%位置募集较多需求，AAA城农商在2.72%-2.83%。(Yilun Ma)

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 (%)	2.40	2.48	2.62	2.65	2.73
今日询价最高利率 (%)	2.40	2.50	2.62	2.68	2.75
涨跌幅 (BP)	0	2	0	3	2

二级存单交易方面：今天月内成交收益率较昨日下午行约5bp-10bp，1M下行约1bp，其余期限较昨日变化不大。

具体来看：月内到期，主要买盘为银行，国股大行成交在2.00%-2.15%，AAA大城农商成交在2.05%-2.20%。二季度到期，主要买盘为基金、银行理财，其中4月到期，国股大行成交在2.48%-2.51%，AAA大城农商成交在2.515%-2.56%；5-6月到期，国股大行成交在2.49%-2.52%，AAA大城农商2.54%-2.55%有少量成交。三季度到期，主要买盘为银行理财，其中7月-9月到期，国股大行成交在2.59%-2.62%，AAA大城农商2.62%-2.67%少量成交。四季度到期，各类型机构均有积极参与，其中10月到期，国股大行成交在2.65%-2.68%，AAA大城农商少量成交在2.70%-2.72%。明年一季度到期，主要买盘为银行理财，国股大行成交在2.73%-2.75%，AAA大城农商2.76%-2.79%少量成交。(Amanda Li)

附：NCD二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	2.50	2.50	2.62	2.675	2.745
	AAA (非国股)	2.54	2.54	2.65	2.72	2.77
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	0	-2	0	-0.5	0
	AAA (非国股)	-1	-1	0	-1	0

## 外币拆借市场

**境内美金拆借市场：**今日境内美金市场流动性由紧转均衡，交投集中在O/N-1W短期限，2W期限有少量交投，中长期限交投清淡。具体来看：O/N市场买盘报在4.60%-4.65%，区间内均有成交；1W市场买盘报在4.64%-4.75%，部分成交在4.70%-4.75%；2W市场部分交投在4.80%；1S市场买盘报在4.80%，卖盘报4.85%；2S市场买盘报在4.95%-5.02%，卖盘稀缺；3S-1Y市场需求报价寥寥，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均衡，有O/N期限成交在4.62%。

**境内美金存单市场：**今日境内美金存单市场暂无交投，今日有股份制询价发行1M在4.70%、2M在4.90%和3M在5.00%；有大行询价发行6M在5.19%、9M在5.25%和1Y在5.31%。

**境外美金拆借市场：**今日境外美金市场流动性整体均衡偏紧，成交集中在O/N-1S期限，2S-3S期限买盘积极，1Y期限有部分交投。具体来看：O/N市场买盘报在4.60%-4.65%，成交集中在4.62%-4.65%；1W市场买盘报在4.68%-4.72%，少量成交在4.72%；2W市场少量成交在4.80%；1S市场买盘报在4.88%-4.90%，少量成交在4.89%；2S市场买盘报在5.05%-5.12%，暂无成交；3S市场买盘报在5.18%-5.30%，部分成交在5.30%；6S市场买盘报在5.35%-5.37%，成交寥寥；9S市场双边报价稀缺；1Y市场买盘在5.47%-5.52%，成交在5.52%。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	4.59	4.61
1W	4.70	4.75
1M	4.90	4.95
3M	5.10	5.15
6M	5.35	5.40
1Y	5.45	5.50

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	4.70	4.90	5.25	5.35	5.45
GBP	4.05	4.18	4.49	4.53	4.62
EUR	2.50	2.74	3.17	3.35	3.48
AUD	3.37	3.56	3.95	4.03	4.20
YEN	-0.05	-0.14	-0.15	-0.16	-0.20
CNH	2.35	2.60	2.65	2.75	2.85
HKD	2.35	3.00	3.65	4.00	4.45

同业存放和非银存款参考报价

2023/03/02 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.55 ~ 2.35	1.8 ~ 1.7
2w	2.85 ~ 2.6	1.9 ~ 1.8
1m	2.95 ~ 2.65	2.4 ~ 2.15
3m	2.73 ~ 2.6	2.58 ~ 2.3
6m	2.92 ~ 2.7	2.68 ~ 2.45
1y	3.01 ~ 2.85	2.8 ~ 2.6

2023/03/02 美金存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	4.85 ~ 4.6	L-10 ~ L-10
2w	4.95 ~ 4.75	L-10 ~ L-10
1m	5.05 ~ 4.85	L+10 ~ L-10
3m	5.25 ~ 5.05	L+10 ~ L-15
6m	5.45 ~ 5.1	L+0 ~ L-15
1y	5.75 ~ 5.4	L+20 ~ L-10

2023/03/02 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	/	/

2023/03/02 非银存款美金各期限双边价格

期限	融出	融入
1W	/	/
2W	/	/
1m	5.9 ~ 5.65	5.55 ~ 5.35
3m	6.05 ~ 5.85	5.75 ~ 5.45
6m	6.25 ~ 6.05	5.95 ~ 5.75
1y	6.45 ~ 6.2	6.15 ~ 5.9

文 / Yilun Ma, Amanda Li, Allen Huang, Zhanglan Yang

联系人: Rachoel Yao  
 邮箱: rachoel.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: 以上所登及列加的所有信息(以下简称“信息”)仅用以提供信息,且为保密的利/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