

# 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

**【2023-04-10】**

## 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
加权利率 (%)	1.3382	1.9982	2.0525	2.0344	2.3485	2.3809	2.4500
涨跌幅 (BP)	-2.84	0.17	0.62	1.06	5.57	2.85	-

交易品种	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
加权利率 (%)	1.3240	2.0040	2.0570	2.3130	2.4140	2.5080	2.5870	2.6500
涨跌幅 (BP)	-5.00	0.70	1.10	-0.90	0.40	0.10	0.10	0.10

【公开市场】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，今日进行180亿元7天期逆回购操作，中标利率为2.00%，与此前持平。今日有20亿元7天期逆回购到期，当日实现净投放160亿元。

今日早盘资金面均衡，股份大行有部分融出。隔夜押利率加权至2.00%融出，押存单信用2.00%至2.10%融出。7天押利率2.10%至加权融出，押存单信用2.25%至2.30%融出。14天押利率加权融出，押信用加权至2.50%融出。21天融出较少，1M押信用2.60%融出。午后资金面均衡，隔夜7天融出较上午减少。隔夜押利率1.90%融出，押存单信用2.00%至2.30%融出。三点后资金面转松，股份大行隔夜加权融出，直至收盘。

今日全天的资金面情绪指数：49-47-51-47

### 存单市场

截至下午5点30分，4月10日有141只同业存单发行，实际发行量2101.2亿，4月11日将有128只存单计划发行，计划发行量为931.7亿。

今日一级存单全期限均为工作日到期，1y部分大行募集较好。具体来看，1M国股询在2.10%，AAA城农商询在2.20%-2.35%；3M国股大行询在2.43%-2.44%，个别大行在2.44%位置募集到大量需求，提前募满，AAA城农商询在2.42%-2.50%；6M国股询在2.42%-2.45%，AAA城农商询在2.48%-2.60%，个别大城商再2.57%位置募集到部分需求；9M国股询在2.45%，AAA城农商询在2.55%-2.67%；1Y大行国股询在2.62%-2.65%，部分大行在2.65%位置获得大量交投并募满，AAA城农商询在2.65%-2.75%，部分城农商行在2.70%-2.75%位置获得一定交投。(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 (%)	2.15	2.44	2.43	2.45	2.65
今日询价最高利率 (%)	2.10	2.44	2.45	2.45	2.65
涨跌幅 (BP)	-5	0	2	0	0

二级存单交易方面：今日资金面均衡，各期限成交收益率震荡持平，1M成交收益率较昨日收盘下行约1bp，6M约上行2bp，3M、9M、1Y较上周五尾盘基本持平。

具体来看：二季度到期，主要买盘为基金和理财，4月到期国股大行成交在1.90%-1.95%，AAA大城农商成交在1.90%-2.01%；5月到期国股大行成交在2.31%-2.32%，AAA大城农商成交在2.33%-2.36%附近；6月到期国股大行成交在2.32%-2.33%，AAA大城农商成交在2.34%-2.35%。三季度到期，主要买盘为基金和理财，7-9月到期国股大行成交在2.43%-2.45%，AAA大城农商成交在2.47%-2.49%附近；四季度到期，各类型机构积极参与，10-12月到期国股大行成交在2.535%-2.545%，AAA大城农商成交在2.57%-2.59%；明年一季度到期，各类型机构积极参与，明年1-3月到期国股大行反复成交在2.63%-2.645%，AAA大城农商主要成交在2.68%；明年二季度到期，主要买盘为理财，其中明年4月到期国股大行成交在2.65%-2.655%，AAA大城农商主要成交在2.70%。(Evan Liu)

### 附：NCD二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	2.32	2.44	2.54	2.63	2.65
	AAA (非国股)	2.35	2.47	2.56	2.68	2.70
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	-1	0	2	0	0
	AAA (非国股)	0	0	0	2	0

## 外币拆借市场

**境内美金拆借市场：**今日境内美金流动性O/N期限偏松，其余期限整体均衡。成交集中在1S内，3S有部分成交，更长期限暂无交投。具体来看：O/N融出供给充足，成交集中在4.85%-4.86%区间。1W买盘活跃，报在4.96%-5.00%，在区间内成交。2W市场双边交投在5.10%附近，并有成交。1S买盘报在5.15%-5.20%，在5.20%水平成交。3S买盘报在5.30%-5.35%，区间内部分成交。更长期限，6S少量买盘报在5.30%-5.35%，融出较少，暂无成交。1Y部分买盘报在5.30%-5.35%，卖盘报在5.35%-5.45%，暂无交投。

**境内美金回购市场:** 今日境内美金回购市场流动性短期均衡偏松, O/N 期限成交在 4.85%。

**境内美金存单市场:** 今日境内有大行成功发行 3S 美金存单在 5.32%。股份制询价发行 1S 在 5.18%-5.19%, 3S 在 5.33%-5.34%, 1Y 在 5.33%-5.34%。

**境外美金拆借市场:** 今日为复活节假期, 境外美金融入需求较少, 流动性整体均衡。成交集中在 O/N-2W 期限, 其余中长期成交寥寥。具体来看: O/N 期限成交集中在 4.85%-4.86%, 1W 买盘报在 4.96%-4.97%, 2W 买盘报在 5.02%-5.05%, 在区间内均有成交。1S 买盘报在 5.15%附近, 2S 买盘报在 5.20%-5.25%, 3S 买盘报在 5.25%-5.35%, 中期融出较少, 交投寥寥。6S-9S 市场双边暂无需求。1Y 部分卖盘报在 5.35%-5.45%, 买盘匮乏, 暂无成交。(Baixiao Ren)

#### 境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	4.84	4.87
1W	4.95	5.00
1M	5.15	5.20
3M	5.30	5.35
6M	5.35	5.40
1Y	5.35	5.45

附: 境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	4.95	5.20	5.30	5.35	5.35
GBP	4.00	4.25	4.51	4.80	5.06
EUR	2.85	3.14	3.29	3.52	3.86
AUD	3.50	3.81	3.86	4.00	4.28
YEN	-0.16	-0.01	0.04	0.16	0.34
CNH	2.15	2.35	2.45	2.65	3.05
HKD	1.95	2.95	3.55	3.85	4.15

#### 同业存放和非银存款参考报价

#### 2023/04/10 非银存款各期限双边价格

期限	融出	融入
1m		
3m		
6m		
1y	3.70~3.30	3.50~3.15
3Y	3.70~3.18	3.50~3.00
5Y	4.20~3.75	4.00~3.50

文 / Yilun Ma, Evan Liu, Baixiao Ren, Yu Qiu

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报及更多资讯



#### 免责声明:

以上所述及附加的所有信息(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,所有前述和保证均经明确免责声明。

[WWW.CFETS-NEX.COM.CN](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)