



【2023-01-28】

人民币回购及NCD

货币市场

周六，质押式回购存款类机构加权价格如下：

交易品种	DR001		DR007		DR014		DR021	
加权利率（%）	1.4245		1.8679		1.9504		1.8125	
涨跌幅（BP）	-26.89		-11.61		-30.83		-78.75	
期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor（%）	1.4320	1.9150	1.9100	2.2720	2.3730	2.4670	2.5350	2.5810
涨跌幅（BP）	-40.20	-7.30	-38.30	-2.20	-0.40	-0.50	0.00	-0.20

【公开市场】央行今日开展 2220 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%。今日 6980 亿元逆回购到期，因此当天净回笼 4760 亿元。

今日资金面均衡宽松，股份制大行有部分融出。隔夜银行押利率加权至加权加点融出；7 天押存单信用 2.1%至 2.25%融出，14 天至 1M 融出较少，成交寥寥；午盘资金面持续宽松，隔夜至 7 天价格较上午变化不大，资金面整体维持宽松态势收盘。（Bella Wang）

今日全天的资金面情绪指数：48-46-43-41

存单市场

截至下午 5 点 30 分，1 月 28 日有 12 只同业存单发行，实际发行量 22.6 亿，1 月 29 日将有 126 只存单计划发行，计划发行量 485.1 亿。

今日一级存单 3M 和 6M 到期日为休息日，其余为工作日到期，全天需求相对清淡，1M 期限有部分银行募集相对不错。具体来看，1M 国股在 2.10%募得部分需求，AAA 城农商询在 2.15%-2.30%，募得部分需求，个别农商行在 2.30%位置有成交；3M（休四）国股询在 2.30%，AAA 城农商询在 2.45%-2.55%，城商行在 2.35%和 2.43%位置获得少量需求；6M（休一）国股大行询在 2.40%，AAA 城农商询在 2.45%-2.55%；9M 国股大行询在 2.40%-2.48%，AAA 城农商询在 2.50%-2.65%，部分城农商在 2.63%-2.65%位置获得一定交投；1Y 国股大行询在 2.50%-2.53%，大行在 2.53%位置获得少量交投，AAA 城农商询在 2.55%-2.70%，个别城商行在 2.70%位置有少量成交。（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（%）	2.15	2.30	2.45	2.45	2.55
今日询价最高利率（%）	2.10	2.30	2.40	2.48	2.53
涨跌幅（BP）	-5	0	-5	3	-2

二级存单交易方面：今天整体交投清淡，第一季度到期成交收益率较春节前下行，其余期限成交收益率较春节前基本持平。

具体来看：2-3 月到期，国股大行成交在 2.04%-2.07%，AAA 大城农商成交在 2.07%-2.12%；4 月到期，国股大行成交在 2.30%-2.34%，AAA 大城农商无成交；5-6 月到期，国股大行成交在 2.35%-2.37%，AAA 大城农商无成交；7-9 月到期，国股大行成交在 2.44%-2.49%，AAA 大城农商少量成交在 2.50%；10-12 月到期，国股大行成交在 2.51%-2.53%，AAA 大城农商无成交；明年 1 月到期，国股大行成交在 2.53%-2.57%，AAA 大城农商无成交。（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)	2.05	2.34	2.46	2.53	2.56
	AAA (非国股)	2.07	2.36	2.50	2.55	2.57
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	-15	-4	1	0	0
	AAA (非国股)	-28	-2	-1	2	1

同业存放和非银存款参考报价

2022/01/28 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.55 ~ 2.35	2.05 ~ 1.85
2w	2.65 ~ 2.4	2.1 ~ 1.9
1m	2.95 ~ 2.65	2.15 ~ 1.9
3m	2.73 ~ 2.65	2.4 ~ 2.2
6m	2.92 ~ 2.7	2.55 ~ 1.9
1y	3.01 ~ 2.75	2.68 ~ 2.2

2022/01/28 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

2022/01/28 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	/	/

2022/01/28 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, Amanda Li, Zhanglan Yang

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报及更多资讯



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