

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

【2024-05-11】

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（截止 14:30）：

交易品种	DR001	DR007	DR014	DR021	DR1M
加权利率 (%)	1.7323	1.8510	1.8858	1.9000	1.9500
涨跌幅 (BP)	0.11	2.82	1.68	0.86	3.75

期限	O/N	1W	1M	2M	1Y
IBO (%)	1.7599	1.9420	2.0500	2.0167	2.7500
涨跌幅 (BP)	-0.65	1.41	6.74	-13.57	-

【公开市场】央行今日进行 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。今日无逆回购到期，当日实现净投放 20 亿元。本周，中国央行进行 120 亿元逆回购操作，因本周有 4500 亿元逆回购到期，本周实现净回笼 4380 亿元。

今日资金面全天均衡偏松。早盘利率隔夜 1.70%-dr+10bps 融出，存单隔夜 1.80%-1.85%融出，7d 押利率地方 1.85%成交。

今日全天的资金面情绪指数：44-48-44-44

存单市场

今日一级存单全期限均为工作日到期，全天交投清淡。

具体来看：

1M 国股行：1.75%，AAA 城农商：1.85%-1.87%；

3M 国股行：1.90%-1.92%，AAA 城农商：1.97%-2.00%；

6M 国股行：1.95%-1.98%，AAA 城农商：2.02%-2.07%（个别城农商在 2.03%位置有少量募集）；

9M 国股行：2.05%-2.07%，AAA 城农商：2.10%-2.20%；

1Y 国股行：2.07%-2.08%，AAA 城农商：2.10%-2.25%；(Wendy Zhu)

二级存单交易方面：截至上午收盘，整体交投清淡，各期限成交收益率较昨日收盘，长端略有上行，其中国股 1M 未见成交，3M 基本持平在 1.93%，6M 未见成交，9M 上行约 1.5bp 至 2.10%，1Y 上行约 1.5bp 至 2.115%。

5 月到期，国股大行少量成交在 1.76%-1.77%；

6 月到期，国股大行未见成交；

7-9 月到期，国股大行主要成交在 1.92%-1.935%；

10-12 月到期，国股大行个别成交在 1.98%-2.00%；

明年 1 月到期，国股大行未见成交；

明年 2-3 月到期，国股大行个别成交在 2.10%附近；

明年 4-5 月到期，国股大行主要成交在 2.10%-2.115%。(Brain Zhang)

同业存放和非银存款参考报价

2024/05/11 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.30~ 1.90	1.80~ 1.60
2w	2.30~ 1.90	1.80~ 1.60
1m	2.40~ 2.15	1.90~ 1.80
3m	2.45~ 2.25	1.95~ 1.90
6m	2.54~ 2.15	2.04~ 1.80
1y	2.68~ 2.25	2.18~ 1.90

2024/05/11 非银存款各期限双边价格

期限	融出	融入
1m		
3m		
6m		
1y	3.20~3.00	2.90~2.70
3Y	3.20~2.90	3.00~2.60
5Y	3.50~3.00	3.30~2.95

文 / Anqi Zhang, Wendy Zhu, Brain Zhang, Baixiao Ren, Yu Qiu