

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

【2024-04-29】

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（截止 17:00）：

交易品种	DR001	DR007	DR014	DR021	DR1M	DR4M
加权利率 (%)	1.8266	2.1024	2.1165	2.2408	2.2400	2.2000
涨跌幅 (BP)	1.45	14.13	11.33	14.08	29.00	10.00

期限	O/N	1W	2W	3W	1M	2M	3M	4M	6M	1Y
IBO (%)	1.9031	2.0745	2.1379	1.7000	2.0632	2.2427	2.5372	2.7167	2.4370	2.8000
涨跌幅 (BP)	4.28	10.27	10.91	/	-12.65	-15.26	22.52	-108.33	/	-35.00

【公开市场】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。因今日有 20 亿元逆回购到期，当日投放资金与回笼资金持平。

今日资金面整体均衡偏松。早盘非银隔夜押利率成交在加权附近，押存单信用在 1.95%附近成交。跨月资金银行需求较多，押利率存单 bid 在 2.10-2.15%位置，非银跨月主要成交在 2.15%-2.20%附近，最高成交到过 2.30%，银行 14 天押利率存单成交在 2.10%。午后资金面逐渐宽松，非银隔夜押存单利率成交在 1.90%，跨月 ofr 变多，堆积在 2.10%，尾盘押利率最低成交到 1.75%，押存单成交到 1.80%。整体偏松直至收盘。(Lily Ye)

今日全天的资金面情绪指数：51-56-49-41

存单市场

截至下午 5 点 30 分，4 月 29 日有 51 只同业存单发行，实际发行量 587.4 亿，4 月 30 日将有 39 只存单计划发行，计划发行量为 340.8 亿。

一级存单方面，今日一级存单全期限均为工作日到期，整体交投清淡。

具体来看，

1M 国股行：1.89%，AAA 城农商：1.90%-1.96%（部分城商在 1.95%、1.96%位置有募集）；

3M 国股行：1.93%，AAA 城农商：1.98%-2.03%；

6M 国股行：1.96%，AAA 城农商：1.95%-2.13%（个别城商在 2.10%位置有少量募集）；

9M 国股行：1.96%，AAA 城农商：2.05%-2.20%（个别城商在 2.20%位置有募集）；

1Y 国股行：2.15%-2.16%（个别大行在 2.16%位置有募集），AAA 城农商：2.10%-2.28%（个别城农商在 2.21%、2.23%位置有募集）。

(Brian Zhang)

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 (%)	1.89	1.93	1.97	1.95	2.10

今日询价最高利率 (%)	1.89	1.93	1.96	1.96	2.16
涨跌幅 (BP)	0	0	-1	+1	+6

二级存单方面，今日各期限成交收益率较昨日收盘整体呈现上行，上午大幅上行，午后开始逐渐回落，其中1M上行约4bp至1.96%，3M上行约1bp至2.03%，6M上行约2bp至2.10%，9M上行约2bp至2.17%，1Y下行约0.5bp至2.17%。

具体来看：5-6月到期，主要买盘是基金和农商，国股大行主要成交在1.90%-2.07%，AAA大城农商主要成交在1.95%-2.10%；三季度到期，主要买盘是理财和基金，国股大行主要成交在2.02%-2.10%，AAA大城农商主要成交在2.05%-2.15%；四季度到期，各类机构交投活跃，国股大行主要成交在2.08%-2.18%，AAA大城农商成交在2.11%-2.18%；明年一季度到期，各类机构交投活跃，国股大行主要成交在2.16%-2.24%，AAA大城农商主要成交在2.205%-2.30%；明年4月到期，各类机构交投活跃，国股大行主要成交在2.16%-2.245%，AAA大城农商主要成交在2.21%-2.27%。(Brian Zhang)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	1.96	2.03	2.10	2.17	2.17
	AAA (非国股)	1.98	2.09	2.12	2.21	2.21
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	4	1	2	2	-0.5
	AAA (非国股)	-2	5	2	2	0

外币拆借市场

境内美金拆借市场：今日境内美元拆借市场流动性隔夜均衡，T/N(6D)-1W 偏紧，2W-3S 均衡，6S 及以上长期限偏宽松，交投集中在3S内。具体来看：O/N 需求集中在5.43%-5.45%，交投在区间内；T/N (6D) 买盘较多，报价集中在5.70%，成交在5.70%；1W 需求在5.70%-5.75%，交投主要在5.70%-5.72%；2W 买盘在5.70%-5.75%，交投在5.70%-5.74%；1S 需求报在5.70%-5.75%，成交在区间内；3S 买盘报在5.72%-5.80%，融出较少；6S、9S 及1Y 融入需求较少，卖盘询出寥寥，交投清淡。

境内美金回购市场：今日境内美元回购市场流动性均衡，成交较少。

境内美金存单市场：今日境内美元存单市场较为清淡，暂无成功发行。

境外美金拆借市场：今日境外美元拆借市场流动性隔夜-1W 均衡，2W-1S 均衡偏松，3S-6S 整体均衡，9S 及以上长期限偏宽松，交投集中在3S内。具体来看：O/N 需求主要在5.34%-5.37%，交投集中在5.35%-5.37%；1W 买盘在5.55%-5.57%，成交在区间内；2W 需求报在5.55%-5.57%，交投主要在5.56%；1S 买盘报在5.60%，卖盘询出在5.62%-5.66%，成交有限；3S、6S 融入需求分别在5.70%-5.75%和5.72%-5.75%，融出分别在5.75%和5.75%-5.76%，听闻市场3S 成交在5.75%附近；9S 少量供给报在5.80%，买盘较少，成交寥寥；1Y 零星需求报在5.75%，融出在5.77%-5.80%，交投清淡。(Kiki Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	5.43	5.45
1W	5.70	5.75
1M	5.65	5.75
3M	5.75	5.85
6M	5.75	5.85
1Y	5.85	5.95

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	5.57	5.62	5.75	5.75	5.77
GBP	5.35	5.38	5.43	5.41	5.37
EUR	4.09	4.10	4.20	4.11	4.08
AUD	4.38	4.45	4.61	4.62	4.60
YEN	0.02	0.05	0.10	0.11	0.14
CNH	1.95	3.50	4.10	3.20	3.20

HKD	4.15	4.15	4.45	4.50	4.70
-----	------	------	------	------	------

同业存放和非银存款参考报价

2024/04/29 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.40~ 1.80	1.90~ 1.50
2w	2.55~ 2.20	2.05~ 1.90
1m	2.40~ 1.90	1.90~ 1.55
3m	2.50~ 1.90	2.00~ 1.55
6m	2.60~ 2.00	2.11~ 1.60
1y	2.71~ 2.10	2.21~ 1.70

2024/04/29 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	3.00~2.75
5Y	3.50~3.00	3.30~2.90

文 / Lily Ye, Brian Zhang, Kiki Huang, 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:

以上所述及列出的所有信息(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