

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

【2023-02-07】

人民币回购及NCD

货币市场

周二，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
加权利率 (%)	2.2791	2.1394	2.1120	2.0560	2.2845	2.3000
涨跌幅 (BP)	46.67	13.55	14.21	14.84	20.84	8.05

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	2.2410	2.0860	2.0630	2.1840	2.3600	2.4730	2.5680	2.6050
涨跌幅 (BP)	45.90	7.90	9.70	1.00	0.10	0.10	0.80	0.80

【公开市场】央行公开市场开展 3930 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%。今日 4710 亿元逆回购到期。

今日资金面均衡偏紧，大行股份非隔夜期限有少量融出。隔夜押利率、存单、信用加权+50bp 不低于 2.50%至 2.60%融出，7 天押利率加权融出，押存单、信用 2.20%至 2.50%融出；14 天押存单、信用 2.45%至 2.55%融出，21 天至 1M 融出较少，1M 非银 2.60%融出，成交寥寥。午盘后资金持续偏紧态势，隔夜非银 3.00%至 3.60%融出，7 天非银 2.50%至 2.90%融出。临近尾盘资金偏紧态势稍有缓解，资金面整体维持均衡态势收盘。

今日全天的资金面情绪指数：63-65-63-55

存单市场

截至下午 5 点 30 分，2 月 7 日有 180 只同业存单发行，实际发行量 1458.4 亿，2 月 8 日将有 140 只存单计划发行，计划发行量为 1531.8 亿。

今日一级存单除 1Y 外，其他期限均为工作日到期，整体情绪偏清淡。具体来看，1M 国股询在 2.05%，AAA 大城商在 2.23%至 2.25%成交；3M 部分国股在 2.40%位置募集到一定需求，AAA 大城商成交在 2.40%，其他城农商需求寥寥；6M 部分大行在 2.50%成交、部分国股在 2.51%有少量需求，AAA 城农商询在 2.50%-2.60%；9M 大行国股在 2.60%交投活跃，多家提前募满截单，AAA 大城商在 2.63%、其他城商在 2.65%至 2.68%位置有成交；1Y (休七) 大行国股最高询在 2.64%，AAA 城农商询在 2.65%-2.75%，受到期日影响需求清淡。(Coco Gao)

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	2.35	2.47	2.60	2.64
今日询价最高利率 (%)	2.05	2.40	2.51	2.60	2.64
涨跌幅 (BP)	-10	5	4	0	0

二级存单交易方面：1M-6M 期限成交收益率呈上行趋势，其中 1M 期限成交收益率较前一交易日上行 7bp 左右。具体来看：一季度到期，主要买盘为农商和基金；其中 2 月到期，国股大行成交在 2.10%-2.30%；AAA 大城农商成交在 2.10%-2.30%；3 月到期，国股大行成交在 2.25%-2.30%，AAA 大城农商成交在 2.28%-2.30%。二季度到期，买盘以理财和银行为主；其中 4 月到期，国股大行成交在 2.37%-2.40%，AAA 大城农商成交在 2.41%-2.44%；5-6 月到期，国股大行成交在 2.38%-2.40%，AAA 大城农商成交在 2.42%-2.46%。三季度到期，买盘以基金为主；其中 7-9 月到期，国股大行成交在 2.49%-2.52%，AAA 大城农商成交在 2.53%-2.55%。四季度到期，买盘以保险资管和基金为主；其中 10-12 月到期，国股大行成交 2.585%-2.60%，AAA 大城农商成交在 2.645%-2.65%。明年一季度到期，买盘主要为保险资管和基金，其中明年 1-2 月到期，国股大行成交在 2.625%-2.64%，AAA 大城农商成交在 2.69%-2.695%。(Ellie Meng)

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率 (%)	AAA (国股)	2.27	2.40	2.51	2.595	2.635
	AAA (非国股)	2.30	2.43	2.55	2.65	2.69
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	7	3	2	0	-0.5
	AAA (非国股)	8	3	3	3	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整体均衡，交投集中在 1S 内期限，3S 期限有少量成交，其他期限交投清淡。具体来看：O/N 市场买盘报在 4.54%-4.55%，区间内有成交；1W 市场买盘报价在 4.57%-4.60%，成交在 4.57%-4.58%；2W 市场买盘报在 4.60%-4.65%，部分成交在 4.65%；1S 市场买盘报价在 4.60%-4.69%，区间内有部分成交；2S 市场买盘稀缺，成交寥寥；3S 市场少量买盘在 4.95%-4.97%，少量成交在 4.97%；6S 市场少量买盘报在 5.10%，成交寥寥；9S-1Y 中长期融出意向报 5.20%附近，仍无成交

境内美金回购市场：今日境内美金回购市场流动性均衡，交投集中在 O/N 期限，成交在 4.54%。

境内美金存单市场：今日境内美金存单市场交投情绪清淡，市场各期限暂无询价。

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 短期限，3S 和 6S 期限有少量成交，其他期限暂无成交。具体来看：O/N 市场买盘报在 4.52%-4.55%，区间内有成交；1W 市场买盘报在 4.56%-4.58%，成交在 4.57%；2W 市场买盘在 4.58%-4.65%，成交在 4.65%；1S 市场买盘报 4.65%-4.68%，成交在 4.68%；2S 市场少量买盘报在 4.80%，成交稀缺；3S 市场少量买盘报在 4.90%-4.92%，成交在 4.92%；长期限市场，6S 部分交投在 5.10%、9S 交投清淡、1Y 部分买盘报在 5.05%-5.15%，鲜有成交(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	4.53	4.55
1W	4.57	4.58
1M	4.68	4.70
3M	4.95	5.00
6M	5.00	5.10
1Y	5.10	5.20

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	4.57	4.68	4.95	5.08	5.12
GBP	3.82	3.92	4.12	4.19	4.14
EUR	2.38	2.47	2.79	3.01	3.09
AUD	3.15	3.28	3.62	3.76	3.91
YEN	-0.18	-0.14	-0.10	-0.16	-0.25
CNH	1.85	2.05	2.45	2.65	3.05
HKD	1.60	2.45	3.50	4.05	4.50



同业存放和非银存款参考报价

2023/02/07 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.55 ~ 2.35	1.9 ~ 1.7
2w	2.65 ~ 2.4	2.15 ~ 1.95
1m	2.95 ~ 2.65	2.3 ~ 2.0
3m	2.73 ~ 2.65	2.4 ~ 2.3
6m	2.92 ~ 2.7	2.58 ~ 2.4
1y	3.01 ~ 2.8	2.68 ~ 2.52

2023/02/07 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

2023/02/07 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	/	/

2023/02/07 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 / Coco Gao, Ellie Meng, Allen Huang, Zhanglan Yang

联系人: Raehoel Yoo
 邮箱: raehoel.yoo@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