



【2024-02-08】

人民币回购及NCD

货币市场

周四，质押式回购存款类机构加权价格如下（截止 17：00）：

品种	DR001	DR007	DR014	DR021	DR1M	DR2M
加权利率 (%)	1.6174	1.7829	1.8808	2.0280	2.2500	2.2500
涨跌幅 (BP)	-8.91	-17.09	-24.11	-25.79	-5.00	-

期限	O/N	1W	2W	3W	1M	2M	3M	4M	1Y
IBO (%)	1.7125	2.2420	1.9629	2.2731	2.3478	2.3478	3.0016	3.2000	2.9300
涨跌 (BP)	-7.87	-10.80	-29.05	-9.08	-22.17	-22.17	29.30	-	-

【公开市场操作】中国央行公开市场今日进行 900 亿元 7 天期逆回购操作，利率持平 1.8%；进行 2550 亿元 14 天期逆回购操作，利率 1.95%，与此前持平。今日有 430 亿元逆回购到期。今日资金面全天呈现偏宽松态势，具体来看：受春节调休影响，非银需求主要集中在 11-14d，隔夜品种回购需求减少，押利率成交在加权至加权+10bp 成交，押存单加权+20bp 至加权+30bp 成交，跨年 11d-14d 期限押利率存单成交在 2.10%至 2.20%且不低于加权附近，公开市场操作后，资金成交价格稍有下行，随着向中午靠近资金面慢慢走松，各个期限供给价格开始下降。午后开盘，资金面继续走向宽松，成交逐渐清淡，隔夜资金价格继续下行，三点附近，隔夜回购在 1.7%附近成交，11d 期限成交来到 2.00%-2.10%附近。临近尾盘，资金面保持宽松态势直至收盘。

今日资金面情绪指数：45-47-40-40

存单市场

截止下午 5 点 30 分，2 月 8 日有 33 只同业存单发行，实际发行量 450.4 亿，2 月 9 日将有 19 只存单计划发行，计划发行量 432.1 亿。

今日一级存单 3M、6M 为休息日到期，全天整体交投偏清淡。

具体来看：

1M AAA 城农商 2.16%

3M 国股行：2.14%-2.15%，AAA 城农商：2.25%

6M 国股行：2.20%-2.28%，AAA 城农商：2.33%-2.38%；

9M 国股行：2.25%-2.30%（在 2.30%募集到量），AAA 城农商：2.35%-2.40%；

1Y 国股行：2.28%-2.30%，AAA 城农商：2.33%-2.44%。(Wendy Zhu)

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 (%)	2.10	2.25	2.33	2.33	2.33
今日询价最高利率 (%)	-	2.15	2.27	2.30	2.32
涨跌幅 (BP)	-	-10	-6	-3	-1

二级存单交易方面：今日各期限成交收益率较昨日收盘整体下行，截至收盘，1M 下行约 10bp 至 2.05%，3M 下行约 10bp 至 2.20%，6M 下行约 6.5bp 至 2.25%，9M 下行约 1.5bp 至 2.30%，1y 下行约 1bp 至 2.30%。

今日交投清淡，具体来看，月内到期，国股大行主要成交在 1.60%-1.75%，AAA 大城农商主要成交在 1.60%-1.70%；三月到期，国股大行主要成交在 2.00%-2.08%，AAA 大城农商个别成交在 2.10%；二季度到期，国股大行主要成交在 2.15%-2.21%，AAA 大城农商主要成交在 2.20%-2.25%；

三季度到期，国股大行主要成交在 2.24%-2.25%，AAA 大城农商少量成交在 2.29%-2.30%；四季度到期，国股大行主要成在 2.28%-2.30%，AAA 大城农商个别成在 2.33%；明年一二月到期，各类型机构交投活跃，国股大行主要成在 2.29%-2.31%，AAA 大城农商少量成在 2.31%-2.33%。(Qi 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)	2.05	2.20	2.250	2.30	2.30
	AAA (非国股)	2.00	2.20	2.29	2.33	2.33
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	-10	-10	-6.5	-1.5	-1
	AAA (非国股)	-18	-11	-6	-3	-2

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整体宽松。临近假期，中长期限需求较少，成交集中在 1S 内。具体来看：O/N 买盘报在 5.33%-5.35%，区间内成交。跨节 T/N-2W 买盘报在 5.48%-5.52%，区间内成交。1S 交投集中在 5.60%。节后起息 3S 少量融入需求报在 5.65%，交投较少。更长期限双边报价寥寥。

境内美金回购市场：今日境内美元回购市场流动性偏松，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整体宽松，成交主要在 1S 内。具体来看：O/N 成交集中在 5.29%-5.30%。1W 买盘报在 5.43%-5.45%，2W 融入需求主要在 5.47%-5.50%，均在区间内成交。1S 买盘较少，卖盘报在 5.60%；3S 融出报在 5.65%，融入需求较少。6S 交投清淡；9S 少量买盘报在 5.45%；1Y 交投寥寥。(Baixiao Ren)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	5.32	5.36
1W	5.45	5.55
1M	5.60	5.65
3M	5.65	5.75
6M	5.60	5.70
1Y	5.40	5.60

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	5.35	5.60	5.60	5.50	5.30
GBP	5.11	5.38	5.40	5.37	5.25
EUR	3.74	4.15	4.09	3.97	3.66
AUD	4.11	5.12	5.15	5.12	5.02
YEN	-0.17	0.03	-0.01	0.02	0.09
CNH	2.90	3.00	2.90	2.80	2.80
HKD	4.55	4.55	4.55	4.65	4.75

同业存放和非银存款参考报价

2024/02/08 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.25~ 1.80	1.95~ 1.60
2w	2.55~ 2.15	2.20~ 1.95
1m	2.55~ 2.20	2.10~ 2.00
3m	2.70~ 2.40	2.25~ 2.20
6m	2.75~ 2.35	2.33~ 2.15
1y	2.76~ 2.40	2.35~ 2.20

2024/02/08 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	3.20~2.80
3Y	3.20~2.80	3.15~2.80
5Y		

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

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