

收盘日评 银行间资金市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2026-04-23】

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 |
|---------|--------|--------|--------|
| 加权利率(%) | 1.2171 | 1.3238 | 1.3518 |
| 涨跌幅(BP) | -0.1 | 0.36 | 0.36 |

| 期限 | IBO001 | IBO007 | IBO014 | IBO21 | IBO1M | IBO2M | IBO3M | IBO6M | IBO1Y |
|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| IBO(%) | 1.2700 | 1.3462 | 1.3879 | 1.2000 | 1.3838 | 1.5751 | 1.6742 | 1.6000 | 1.5300 |
| 涨跌(BP) | 0.23 | 1.02 | 3.32 | -17.33 | -18.26 | 3.01 | 2.17 | -- | -- |

中国央行今日开展 5 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 5 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现零投放零回笼。

今日资金面整体呈均衡偏松态势。早盘隔夜和 7d 交投活跃，具体来看：隔夜押利率成交在 1.33%-1.35%附近，押存单成交在 1.35%-1.36%，押信用成交在 1.39%左右；7d 押利率存单成交 1.37%-1.38%附近，押信用 ofr 在 1.40%；跨月方面，押利率成交在 1.39%位置，押信用 ofr 在 1.42%附近。临近午盘，隔夜押利率成交在 1.33%附近，押存单成交在 1.35%左右；7d 押利率存单融出在 1.37%附近，押信用融出在 1.38%-1.40%左右。跨月 14d 押信用降至 1.40%附近融出。

午后资金面呈均衡态势，交投略显清淡。隔夜押利率成交小幅上升至 1.35%附近，押存单成交在 1.35%-1.36%附近。临近尾盘，隔夜押利率成交下探至 1.31%，押存单成交在 1.36%附近。

今日全天的资金面情绪指数：47-48-50-49

外币拆借市场

境内美金拆借市场：今日境内银行间美元拆借市场流动性 O/N-1W 均衡，2W 偏紧，1M 转均衡，3M 均衡偏紧，更长期限整体均衡。具体来看：O/N 日内交投稳定在 3.65%-3.66%；1W 需求以跨月期限为主，报在 3.68%-3.73%，区间内少量交投；2W 融入需求活跃，买盘堆积，报在 3.68%-3.83%，在 3.71%-3.74%区间成交。1M 需求相对减弱，买盘报在 3.69%-3.84%；3M 买盘报在 3.69%-3.90%，1M-3M 融出寥寥。6M 融入需求报在 3.69%-3.95%；9M-1Y 个别买盘报在 4.00%，长期未闻成交。

今日境内非银拆借市场，1W 期限成交在 3.72%，2W-1M 期限需求寥寥。中长期方面，3M 期限少量成交在 3.92%，4-5M 期限少量成交在 3.93%，6M 买盘报在 3.92%-3.95%，在 3.95%部分成交，6M 以上期限未闻成交。

境内美金回购市场：今天境内银行间回购市场报价寥寥，未闻成交。

今日境内非银美元回购市场有部分买盘询借 4M-7M 在 3.80%，交投较少。

境外美金拆借市场：今日境外银行间美元拆借市场流动性 O/N-1W 均衡偏松，2W 均衡，1M-3M 均衡偏松，6M-1Y 偏松。具体看：O/N 集中在 3.63%-3.65%区间成交；1W 少量买盘报在 3.68%-3.76%，融出有限；2W 融入报价小幅上涨，报在 3.72%-3.80%，少量融出报在 3.80%。1M 融入需求报在 3.72%-3.81%，在 3.81%成交；3M 在 3.92-3.93%位置融出活跃，并有成交。6M 少量需求报在 3.88%-3.90%，融出较少；9M 买盘报在 3.90%-3.995%，融出报在 3.995%-4.00%，在 3.995%位置部分成交；1Y 市场双边对峙在 3.90%-3.95%/4.00%，成交寥寥。

境内外币拆借市场美元收盘价格

| USD | Bid | Ask |
|-----|------|------|
| O/N | 3.63 | 3.66 |
| 1W | 3.65 | 3.70 |
| 1M | 3.72 | 3.80 |
| 3M | 3.75 | 3.80 |
| 6M | 3.80 | 3.95 |
| 1Y | 3.90 | 4.00 |

附：境外各币种全期限拆借价格

| 币种 | 1W | 1S | 3S | 6S | 1Y |
|-----|------|------|------|------|------|
| USD | 3.68 | 3.81 | 3.90 | 3.95 | 3.95 |
| GBP | 3.90 | 3.92 | 4.10 | 4.28 | 4.47 |
| EUR | 1.98 | 2.11 | 2.29 | 2.46 | 2.62 |
| AUD | 4.17 | 4.37 | 4.57 | 4.72 | 4.91 |
| YEN | 0.55 | 0.69 | 0.82 | 0.95 | 1.16 |
| CNH | 1.25 | 1.45 | 1.45 | 1.55 | 1.55 |
| HKD | 2.40 | 2.40 | 2.50 | 2.70 | 2.95 |

免责声明：本日评由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日评内容。日评所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，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，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日评任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。