



【2023-03-14】

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（%）	1.8260	2.0780	2.0899	2.4000	2.6901	2.6857
涨跌幅（BP）	21.29	11.01	3.03	-5.29	2.28	1.95

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor（%）	1.8290	2.0550	2.0660	2.3780	2.4990	2.5980	2.6720	2.7460
涨跌幅（BP）	21.50	9.60	5.70	0.70	0.10	-	0.10	-0.30

【公开市场】央行公开市场开展 290 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%。今日 30 亿元逆回购到期。

今日资金面整体均衡， 大行国股有融出。隔夜银行押利率加权至+20bps 融出， 押存单信用加权+20bps 至+40bps 不低于 1.90%或 2.00%融出。7 天银行押利率加权或不低于 2.20%融出， 非银押存单信用 2.30%至 2.50%融出。14 天银行押利率 2.15%融出， 非银 2.50%融出。21 天押存单信用 2.80%至 3.10%融出。28 天押信用 2.70%有成交。午后资金面维持均衡态势。融出价格较上午相差不大。三点后隔夜供给增加， 隔夜非银加权融出， 银行押利率减点融出。整体资金面均衡偏松至收盘。

今日全天的资金面情绪指数：49-49-50-47

存单市场

截至下午 5 点 30 分， 3 月 14 日有 149 只同业存单发行， 实际发行量 1372.3 亿， 3 月 15 日将有 115 只存单计划发行， 计划发行量为 805.7 亿。

今日一级存单仅 3M 为工作日到期， 整体交投清淡。具体来看， 1M（休一）国股询在 2.00%-2.39%， AAA 城农商询在 2.50%-2.57%， 个别城商在 2.57%有一定需求； 3M 国股最高询在 2.50%， 募集较好， 其他国股在 2.49%需求寥寥， AAA 部分城农商在 2.53%-2.55%有成交； 6M（休二）国股询在 2.55%， AAA 城农商询在 2.58%-2.70%； 9M（休二）国股询在 2.60%， AAA 城农商询在 2.65%-2.73%； 1Y（休二）大行国股询在 2.68%， AAA 城农商询在 2.72%-2.80%， 受到期日影响需求寥寥。(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（%）	2.38	2.45	2.55	2.65	2.72
今日询价最高利率（%）	2.00	2.50	2.55	2.60	2.68
涨跌幅（BP）	-38	5	0	-5	-4

二级存单交易方面： 今日二级存单 1m 收益率较昨日有所上行， 6m-1y 存单收益率略有下行。

具体来看： 月内到期， 主要买盘为农商， 主要卖盘为基金， 国股大行成交在 2.05%-2.20%， AAA 大城农商成交在 2.10%-2.20%。二季度到期， 主要买盘为理财和银行， 主要卖盘为基金， 其中 4 月到期， 国股大行成交在 2.47%-2.50%， AAA 大城农商成交在 2.58%-2.60%； 5-6 月到期， 国股大行成交在 2.49%-2.50%， AAA 大城农商成交在 2.54%-2.56%。三季度到期， 主要买盘为银行， 国股大行成交在 2.58%-2.60%， AAA 大城农商成交在 2.62%-2.64%。四季度到期， 主要买盘为银行和农商， 国股大行成交在 2.635%-2.65%， AAA 大城农商成交在 2.68%-2.69%附近。明年一季度到期， 国股大行成交在 2.715%-2.73%， AAA 大城农商少量成交在 2.755%-2.76%。(Scott 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）	2.51	2.50	2.58	2.64	2.72
	AAA（非国股）	2.60	2.55	2.63	2.69	2.755
与昨日收益变动对照（BP）	AAA（国股）	3	0	-1	-0.5	-0.5
	AAA（非国股）	10	0	0	0	-0.5

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短期限偏紧， 边际趋松， 中长期期限均衡偏紧， 交投集中在 O/N-2W 短期限， 3S 期限有少量成交， 更长期限报价寥寥， 暂无成交。具体来看： O/N 市场买盘报在 4.61%-4.67%， 区间内有成交， 交投集中在 4.63%-4.66%； 1W 市场买盘集中报在 4.62%-4.85%， 成交在 4.76%-4.85%； 2W 市场买盘在 4.85%-4.97%， 成交集中在 4.93%-4.95%； 1S 市场少量买盘报在 5.05%-5.15%、 2S 市场少量买盘报在 5.20%， 成交寥寥； 3S 市场少量买盘报 5.25%-5.30%， 成交在 5.30%； 6S-1Y 长期限市场交投清淡。

境内美金回购市场： 今日境内美金回购市场流动性整体均衡偏紧， 有 O/N 期限成交在 4.65%。

境内美金存单市场： 今日境内美金存单市场交投情绪清淡， 今日有股份询询价发行 1M 在 5.10%； 其他期限暂无询价发行。

境外美金拆借市场： 今日境外美金市场流动性各期限均衡稍紧， 交投集中在 O/N-1W 短期限， 1S 期限有部分成交， 3S 和 1Y 期限有少量融出， 暂无成交。具体来看： O/N 市场买盘报在 4.60%-4.65%， 成交在 4.63%-4.65%； 1W 市场买盘报在 4.68%-4.82%， 成交在 4.78%-4.82%； 2W 市

场少量买盘报在 4.95%，成交寥寥；1S 市场买盘报在 5.05%-5.10%，区间内有部分成交；2S 市场买盘报价在 5.05%-5.20%、3S 市场买盘报在 5.20%-5.40%，暂无成交；6S 市场买盘报在 5.30%-5.40%，卖盘寥寥；9S 市场双边报价仍稀缺；1Y 市场买盘报价下行至 5.20%-5.40%，少量卖盘报在 5.45%附近。(Allen Huang)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	4.60	4.65
1W	4.78	4.85
1M	5.10	5.15
3M	5.30	5.40
6M	5.50	5.60
1Y	5.70	5.80

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	4.70	5.05	5.30	5.35	5.40
GBP	3.75	4.00	4.37	4.74	5.02
EUR	2.14	2.38	2.88	3.24	3.63
AUD	3.54	3.69	4.03	4.20	4.49
YEN	-0.33	-0.62	0.07	0.17	0.42
CNH	2.30	2.45	2.65	2.75	2.95
HKD	2.35	3.25	4.10	4.50	4.90

同业存放和非银存款参考报价

2023/03/14 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.15 ~ 1.95	1.9 ~ 1.8
2w	2.55 ~ 2.05	1.95 ~ 1.85
1m	3.05 ~ 2.9	2.85 ~ 2.2
3m	2.85 ~ 2.65	2.61 ~ 2.35
6m	2.92 ~ 2.75	2.65 ~ 2.3
1y	3.01 ~ 2.85	2.8 ~ 2.55

2023/03/14 美金存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	4.95 ~ 4.7	L-10 ~ L-10
2w	5.05 ~ 4.8	L-10 ~ L-10
1m	5.15 ~ 4.9	L+10 ~ L-10
3m	5.25 ~ 5.15	L+10 ~ L-15
6m	5.45 ~ 5.1	L+0 ~ L-15
1y	5.75 ~ 5.4	L+20 ~ L-10

2023/03/14 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	/	/

2023/03/14 非银存款美金各期限双边价格

期限	融出	融入
1W	/	/
2W	/	/
1m	5.9 ~ 5.65	5.55 ~ 5.35
3m	6.05 ~ 5.85	5.75 ~ 5.45
6m	6.25 ~ 6.05	5.95 ~ 5.75
1y	6.45 ~ 6.2	6.15 ~ 5.9

文 / Coco Gao, Scott Zhang, Allen Huang, Zhanglan Yang

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评及更多资讯



免责声明:
以上所含及附加的所有信息(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