

# 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

【2023-03-13】

## 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：

交易品种	DR001	DR007	DR014	DR021	DR1M	DR2M	DR1Y
加权利率 (%)	1.6131	1.9679	2.0596	2.4529	2.6673	2.6662	2.8500
涨跌幅 (BP)	-20.11	-5.74	-2.41	38.71	0.49	6.62	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor (%)	1.6140	1.9590	2.0090	2.3710	2.4980	2.5980	2.6710	2.7490
涨跌幅 (BP)	-21.50	-5.40	-7.10	0.70	0.10	0.20	0.10	-0.10

【公开市场】央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，今日进行410亿元7天期逆回购操作，中标利率为2.00%，与此前持平。今日有70亿元7天期逆回购到期，当日实现净投放340亿元。

今日资金面均衡，国股大行有部分融出。隔夜押信用加权+20bp至加权+30bps融出，在2.00%附近。7天银行押利率加权融出，非银押存单信用2.15%至2.30%融出。14天押利率2.15%融出，押存单2.45%融出。21天融出较少，1M押存单2.80%融出。7天价格略上扬，从早盘2.15%上至2.30%至2.40%融出，午后资金面整体维持宽松直至收盘。

今日全天的资金面情绪指数：50-50-50-47

### 存单市场

截至下午5点30分，3月13日有148只同业存单发行，实际发行量1613.9亿，3月14日将有158只存单计划发行，计划发行量为1564.2亿。

今日一级存单除1M期限外，其余各期限均为工作日到期。6m、9m和1y期限部分城农商行募集较好，大行在9m期限也获得较多需求。具体来看，1M国股询在2.00%，AAA城农商询在2.50%-2.55%；3M国股大行询在2.45%，AAA城农商询在2.53%-2.60%，个别农商行在2.55%位置获得部分交投，提前募满；6M大行国股询在2.55%，AAA城农商询在2.58%-2.72%，部分城农商行在2.63%-2.68%获得较好需求，提前募满；9M大行国股询在2.62%-2.65%，国股大行在2.64%-2.65%位置获得大量需求，AAA城农商询在2.66%-2.74%，部分城农商行在2.68%-2.74%位置获得较好需求并募满；1Y大行国股询在2.70%-2.72%，大行在2.72%位置有部分募集，AAA城农商询在2.72%-2.83%，部分城农商行在2.76%-2.79%位置募满。(Yilun Ma)

### 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 (%)	2.00	2.48	2.55	2.66	2.73
今日询价最高利率 (%)	2.38	2.45	2.55	2.65	2.72
涨跌幅 (BP)	38	-3	0	-1	-1

二级存单交易方面：今日二级存单收益率先下后上，基本持平周五收盘收益率。

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1.90%-2.07%，AAA大城农商成交在2.07%-2.10%。二季度到期，主要买盘为理财和银行，其中4月到期，国股大行成交在2.47%-2.49%，AAA大城农商成交在2.50%-2.56%；5-6月到期，国股大行成交在2.49%-2.505%，AAA大城农商成交在2.53%-2.55%。三季度到期，主要买盘为银行和基金，国股大行成交在2.575%-2.60%，AAA大城农商成交在2.62%-2.64%。四季度到期，主要买盘为银行和券商，国股大行成交在2.63%-2.655%，AAA大城农商成交在2.68%-2.70%附近。明年一季度到期，国股大行成交在2.71%-2.73%，AAA大城农商成交寥寥。(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)	2.48	2.50	2.59	2.645	2.725
	AAA (非国股)	2.50	2.55	2.63	2.69	2.76
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA (国股)	2	1	0	-0.5	0
	AAA (非国股)	0	0	0	1	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偏紧，O/N-2W买盘积极且成交集中在短期限，1S期限有少量成交，3S以上中期限交投清淡。具体来看：O/N市场买盘报在4.61%-4.67%，成交集中在4.63%-4.67%；1W市场买盘集中报在4.62%-4.82%，部分成交在4.76%-4.82%；2W市场买盘在4.85%-4.95%，成交集中在4.93%-4.95%；1S市场买盘报在5.00%-5.10%，少量成交在5.00%；2S市场少量买盘报在5.20%-5.25%；3S市场少量买盘报5.30%，暂无成交；6S-1Y市场双边报价寥寥，鲜有成交。

**境内美金回购市场：**今日境内美金回购市场流动性整体偏紧，有O/N期限成交在4.63%。

**境内美金存单市场：**今日境内美金存单市场交投寥寥，今日有大行询价发行6M在5.37%、9M在5.45%和1Y在5.53%。

**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，隔夜期限有部分交投，1S和3S期限有少量成交，6S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4.64%-4.65%；1W市场买盘报在4.70%-4.80%、2W市场买盘在4.85%-4.95%，

均无成交；1S 市场买盘报在 5.05%-5.15%，少量成交在 5.10%-5.11%；2S 市场少量买盘报价在 5.20%-5.35%，卖盘寥寥；3S 市场买盘报在 5.40%-5.52%，少量成交在 5.52%；6S 市场买盘报在 5.60%-5.85%，少量卖盘报 5.85；9S 市场双边报价稀缺；1Y 市场买盘报价下行至 5.55%-5.68%，少量卖盘报在 5.70%-5.80%。(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	4.76	4.79
1M	5.05	5.15
3M	5.15	5.30
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	4.78	5.10	5.45	5.55	5.65
GBP	4.01	4.22	4.58	4.73	4.92
EUR	2.49	2.76	3.32	3.58	3.83
AUD	4.02	4.16	4.56	4.67	4.87
YEN	-0.12	-0.47	0.18	0.17	0.16
CNH	2.25	2.65	2.75	2.85	3.15
HKD	2.40	3.35	4.15	4.45	4.75

### 同业存放和非银存款参考报价

#### 2023/03/13 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.15 ~ 1.95	1.9 ~ 1.7
2w	2.55 ~ 2.05	2 ~ 1.8
1m	2.95 ~ 2.75	2.4 ~ 2.2
3m	2.73 ~ 2.6	2.55 ~ 2.35
6m	2.92 ~ 2.75	2.68 ~ 2.35
1y	3.01 ~ 2.85	2.8 ~ 2.6

#### 2023/03/13 美金存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	4.95 ~ 4.7	4.65 ~ L-10
2w	5.05 ~ 4.8	4.75 ~ 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

#### 2023/03/13 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	/	/

#### 2023/03/13 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 / Yilun Ma, Scott Zhang, Allen Huang, Zhanglan Yang

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:  
 以上所述及附加的所有信息(以下简称“信息”)仅用以提供信息,且为保密和/或专用的信息,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,所有陈述和保证均按免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN