常规报告系列

收盘日评
银行间货币市场

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

【2023-01-29】

人民币回购及NCD

货币市场

周日，质押式回购存款类机构加权价格如下：

交易品种	DR001	DR007	DR014	DR021	DM2M
加权利率（%）	1.1421	1.8343	1.9368	1.8800	2.3000
涨跌幅（BP）	-28.24	-3.36	-1.36	6.75	-

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor（%）	1.2020	1.8540	1.9300	2.2640	2.3670	2.4660	2.5320	2.5770
涨跌幅（BP）	-23.00	-6.10	2.00	-0.80	-0.60	-0.10	-0.30	-0.40

【公开市场】央行开展 1280 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%，今日无逆回购到期。

今日资金面均衡宽松，股份制大行有部分融出。隔夜供给充裕，跨月期限融出报价较少。隔夜押利率加权融出，押存单信用加权+20bps 至 1.80%融出；7 天押存单信用 2.05%至 2.10%融出，14 天至 1M 融出较少，成交寥寥；午盘资金面持续宽松，隔夜至 7 天价格较上午变化不大，资金面整体维持宽松态势收盘。（Bella Wang）

今日全天的资金面情绪指数：45-45-42-40

存单市场

截至下午 5 点 30 分，1 月 29 日有 117 只同业存单发行，实际发行量 298.9 亿，1 月 30 日将有 166 只存单计划发行，计划发行量 1411.8 亿。

今日一级存单除 3M 到期日为休息日外，其余均为工作日到期，今天全天交投相对活跃，其中 1M 期限需求旺盛。具体来看，1M 国股在 2.15%位置交投火爆，供不应求并提前募满，AAA 城农商询在 2.10%-2.20%，部分城商行在 2.17%到 2.20%位置需求较好并募满；3M（休四）国股询在 2.30%-2.35%，AAA 城农商询在 2.30%-2.45%；6M 国股大行询在 2.40%，AAA 城农商询在 2.48%-2.56%，部分城商行在 2.55-2.56%位置获得不错需求；9M 国股大行询在 2.45%-2.50%，AAA 城农商询在 2.50%-2.65%，个别城商行在 2.63%位置募满；1Y 国股大行询在 2.50%-2.55%，AAA 城农商询在 2.55%-2.70%，部分城商行在 2.70%位置募满。(Bella Wang)

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	2.30	2.40	2.48	2.53
今日询价最高利率（%）	2.15	2.35	2.40	2.50	2.55
涨跌幅（BP）	5	5	0	2	2

二级存单交易方面：整体交投清淡，各期限成交收益率较昨日基本持平。

具体来看：2 月到期，国股大行成交 2.02%-2.07%，AAA 大城农商成交 2.06%-2.10%；3 月到期，国股大行成交 2.05%-2.10%，AAA 大城农商成交无成交；4 月到期，国股大行成交 2.32%-2.35%，AAA 大城农商无成交；5-6 月到期，国股大行成交 2.35%-2.36%，AAA 大城农商无成交；7-9 月到期，国股大行成交 2.45%-2.50%， AAA 大城农商少量成交 2.52%-2.53%；10-12 月到期，国股大行成交 2.52%-2.54%， AAA 大城农商无成交；明年 1 月到期，国股大行成交 2.53%-2.545%，AAA 大城农商无成交。（Amanda Li）

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率（%）	AAA（国股）	2.06	2.34	2.46	2.53	2.55
	AAA（非国股）	2.09	2.38	2.50	2.56	2.58
与昨日收益变动对照（BP）	AAA（国股）	1	0	0	0	-1
	AAA（非国股）	2	2	0	1	1

同业存放和非银存款参考报价

2022/01/29 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.55 ~ 2.35	2.15 ~ 1.9
2w	2.65 ~ 2.4	2.25 ~ 2.05
1m	2.95 ~ 2.65	2.25 ~ 1.9
3m	2.73 ~ 2.65	2.4 ~ 2.23
6m	2.92 ~ 2.7	2.57 ~ 1.9
1y	3.01 ~ 2.75	2.7 ~ 2.2

2022/01/29 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

2022/01/29 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	/	/

2022/01/29 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 / Bella Wang, Amanda Li, 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