



【2023-04-14】

人民币回购及NCD

货币市场

周五，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（%）	1.6136	2.0154	2.0172	2.3176	2.3559	2.3333
涨跌幅（BP）	30.48	2.19	3.32	12.36	6.36	1.33

期限	O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
Shibor（%）	1.6050	2.0000	2.0150	2.3060	2.4220	2.5080	2.5880	2.6500
涨跌幅（BP）	27.90	0.20	0.30	-0.10	0.10	-0.10	-	-

【公开市场操作】央行公开市场今日进行 150 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 2.00%，与此前持平。因今日 170 亿元逆回购到期，实现净回笼 20 亿元。

今日资金面整体均衡转松，早盘资金面均衡，大行股份制有部分融出。隔夜押利率加权+10bps 至加权+30bps 融出，押存单信用 1.90%至 2.10% 融出。7 天押利率 2.10%融出，押存单信用 2.10%至 2.25%融出。14 天押存单信用利率 2.10%融出。21 天至 1M 融出较少，成交寥寥。午盘后资金面较上午宽松，隔夜押存单信用 1.85%至 1.95%融出，7 天至 1M 融出较少，成交寥寥。整体维持均衡偏松态势至收盘。

今日全天的资金面情绪指数：49-51-48-43

存单市场

截至下午 5 点 30 分，4 月 14 日有 178 只同业存单发行，实际发行量 2375.6 亿，4 月 17 日将有 132 只存单计划发行，计划发行量为 1440.5 亿。

一级存单方面，今日各期限均为工作日到期。具体来看，1M 国股询在 2.10%，AAA 城农商行询在 2.20%至 2.35%，部门城商行在 2.30%-2.32% 位置募集到量；3M 国股大行询在 2.40%-2.43%，大行在 2.43%位置募集到较好需求，AAA 城农商行询在 2.42%至 2.55%；6M 国股询在 2.48%-2.50%，非传统股份制询在 2.51%-2.60%，在 2.60%位置需求较好，AAA 城农商行询在 2.53%至 2.62%，部分城商在 2.55%-2.57%位置成交，募到一定需求；9M 国股询在 2.45%至 2.50%，非传统股份行询在 2.60%-2.63%，AAA 城农商行询在 2.60%至 2.67%，需求寥寥；1Y 国股大行最高询在 2.63%，大行提至 2.63%后匀速上量，AAA 城农商行询在 2.65%至 2.72%，部分城商行在 2.70%-2.72%位置需求较好。(Grace Zhou)

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（%）	2.05	2.43	2.51	2.50	2.63
今日询价最高利率（%）	2.10	2.43	2.50	2.50	2.63
涨跌幅（BP）	5	0	-1	0	0

二级存单交易方面：6M、9M 震荡小幅上行 0.5bp，足年较上一交易日上行 1bp 左右。

具体来看：二季度到期，主要买盘为基金和理财，4 月到期国股大行成交在 1.90%-1.93%，AAA 大城农商成交在 1.9%-1.95%；5 月到期国股大行成交在 2.30%-2.31%，AAA 大城农商成交在 2.31%-2.35%；6 月到期国股大行成交在 2.30%-2.33%，AAA 大城农商成交在 2.35%。三季度到期，主要买盘为银行和理财，7-9 月到期国股大行成交在 2.43%-2.44%，AAA 大城农商成交在 2.47%-2.49%；四季度到期，主要买盘为银行和理财，10-12 月到期国股大行成交在 2.49%-2.51%，AAA 大城农商成交在 2.54%-2.585%；明年一季度到期，各类型机构积极参与，明年 1-3 月到期国股大行成交在 2.58%-2.605%，AAA 大城农商成交在 2.65%-2.67%；明年二季度到期，各类型机构积极参与，其中明年 4 月到期国股大行成交在 2.62%-2.64%，AAA 大城农商主要成交在 2.67%-2.68%。（Evan Liu）

附：NCD 二级成交收益率

	评级	1M	3M	6M	9M	1Y
绝对收益率（%）	AAA（国股）	2.30	2.44	2.51	2.60	2.64
	AAA（非国股）	2.35	2.48	2.585	2.665	2.66
与昨日收益变动对照（BP）	AAA（国股）	0	0	0	-0.5	1
	AAA（非国股）	-1	1.5	2	2	-1

外币拆借市场

境内美金拆借市场：今日境内美金流动性短期均衡偏松，中长期限均衡。成交集中在 1S 内，3S-6S 有部分成交，其余更长期限成交寥寥。具体来看，O/N-1W 融出供给充裕，O/N 成交集中在 4.85%-4.88%，1W 买盘报在 4.98%-5.03%，成交集中在 5.00%附近。2W 部分买盘报在 5.08%-

5.12%，在区间内成交。1S 供需均衡，买盘报在 5.18%-5.20%，在区间内成交。3S 买盘报在 5.35%-5.42%，区间内有成交。6S 有非银买盘报在 5.55%附近，并有成交。9S-1Y 融入需求寥寥，1Y 有部分卖盘报在 5.40%附近，整体交投清淡。

境内美金回购市场：今日境内美金回购市场流动性短期偏松，有 O/N 期限成交在 4.86%。

境内美金存单市场：今日境内美金存单市场较为清淡，暂无交投。

境外美金拆借市场：今日境外美金流动性 O/N 期限偏松，其余期限整体均衡。成交集中在 O/N-1W。具体来看：O/N 期限成交在 4.85%-4.86%。1W 买盘活跃，报在 4.96%-4.98%，成交集中在 4.98%附近。2W 买盘报在 5.05%-5.08%，卖盘报在 5.12%-5.20%，成交较少。中长期限融出有限，成交寥寥：1S 买盘报在 5.20%；2S 买盘报在 5.25%附近；3S 买盘报在 5.34%-5.38%，3S 部分卖盘报在 5.45%。6S 买盘报在 5.30%-5.32%，卖盘匮乏。1Y 少量买盘报在 5.30%，卖盘报在 5.40%-5.45%，交投清淡。(Baixiao Ren)

境内外币拆借市场美元收盘价格

USD	Bid	Ask
O/N	4.85	4.88
1W	4.97	5.03
1M	5.15	5.25
3M	5.35	5.40
6M	5.35	5.40
1Y	5.35	5.40

附：境外各币种全期限拆借价格

币种	1W	1S	3S	6S	1Y
USD	4.98	5.20	5.35	5.32	5.30
GBP	4.14	4.34	4.57	4.71	4.96
EUR	2.95	3.17	3.42	3.61	3.86
AUD	3.44	3.80	3.90	3.95	4.20
YEN	-0.14	-0.05	-0.01	-0.03	0.067
CNH	1.85	2.15	2.45	2.55	2.85
HKD	2.25	2.75	3.45	3.85	4.15

同业存放和非银存款参考报价

本周线下资金各期限吸收报价为：7 天 1.60%-1.99%，14 天 1.70%-2.00%，1 个月 2.00%-2.20%，3 个月 2.20%-2.53%，6 个月 2.10%-2.60%，1 年 2.35%-2.72%

2023/04/13 存放市场各期限双边价格

期限	融出	融入
1w	2.30~ 1.80	1.99~ 1.60
2w	2.35~ 1.85	2.00~ 1.70
1m	2.60~ 2.30	2.20~ 2.00
3m	2.65~ 2.50	2.53~ 2.25
6m	2.88~ 2.65	2.60~ 2.20
1y	3.05~ 2.80	2.72~ 2.35

2023/04/13 非银存款各期限双边价格

期限	融出	融入
1m		
3m		
6m		
1y	3.70~3.30	3.50~3.15
3Y	3.75~3.18	3.50~3.00
5Y	4.20~3.75	4.00~3.50

文 / Grace Zhou, Evan Liu, 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