



【2023-07-19】

 中国人民银行今日进行 250 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.90%，与此前持平。今日有 20 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.95%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 2.1000%，与上一交易日不变。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.4425%附近，后在 2.44%-2.4475%区间附近震荡成交，午盘报收 44.75/44.5。中午回来，国债期货震荡下行，5y repo 稍微上行，震荡成交在 2.445%-2.455%区间附近，尾盘报收 45.25/45。1y repo 全天震荡成交在 2.02%-2.03%区间附近，尾盘报收 02.5/02.25。其他期限，3m repo 成交在 1.975%附近，6m repo 成交在 2.0025%-2.005%附近，9m repo 成交在 2.0125%附近，2y repo 成交在 2.115%-2.1125%区间附近，3y 成交在 2.245%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在 01.5bp 附近，1x2y repo 成交在 09bp 附近，3x5y repo 成交在 21bp 附近，2x3y repo 成交在 33bp 附近，1x5y repo 成交在 42-42.75bp 附近，报收 42.75/42.5

 Shibor 端，1y shibor 成交在 2.205%附近，报收 20.5/20，5y shibor 成交在 2.7325%-2.745%附近，报收 74.75/74。曲线方面，1x5y shibor 成交在 54bp 附近，报收 54.5/54。基差方面，1y basis 报收 18/17.5，5y basis 成交在 28.75-29.25bp 附近，报收 29.5/29。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

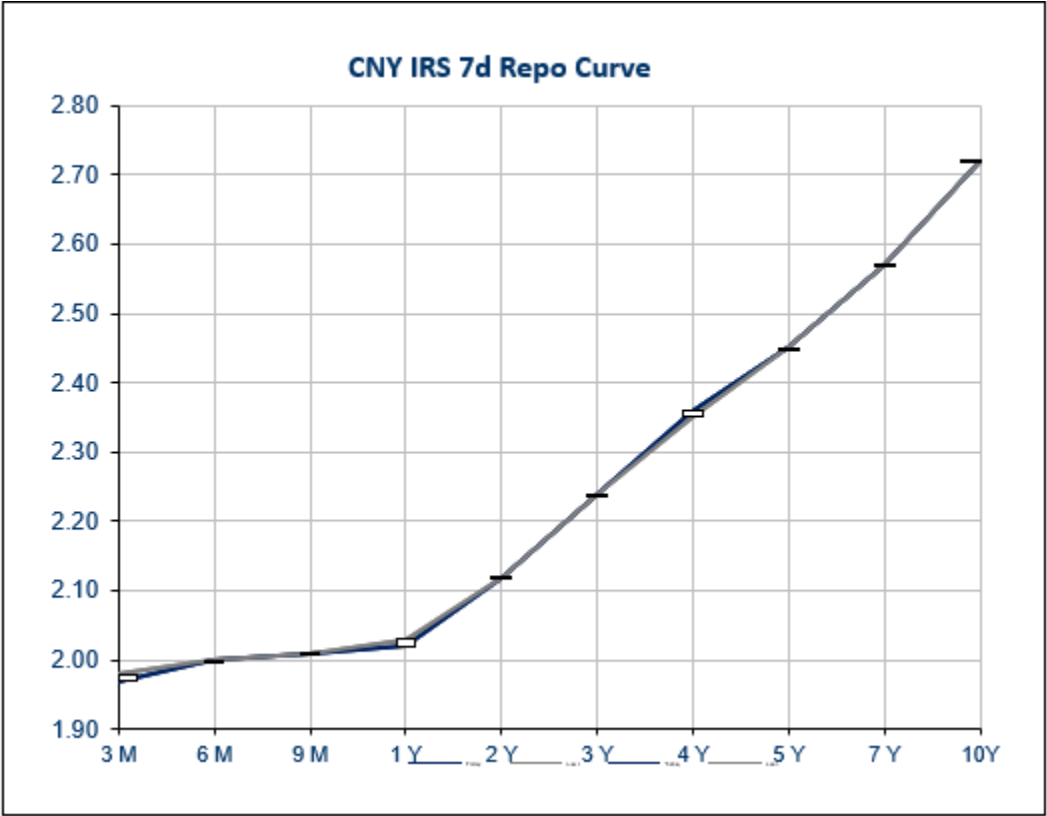
2023/7/19 Wednesday

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd												OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO					
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365					
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp			
3 M	1.97	-1				3 M	1.59	-									
6 M	2	-	6 M	2.13	-	6 M	1.57	-									
9 M	2.01	-	9 M	2.16	-	9 M	1.61	-									
1 Y	2.02	-1	1 Y	2.2	-1	1 Y	1.62	-				1Y	2.01	-			
2 Y	2.12	-	2 Y	2.34	1	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.1	-			
3 Y	2.24	-	3 Y	2.47	1	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.21	-			
4 Y	2.36	1	4 Y	2.61	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.32	1			
5 Y	2.45	-	5 Y	2.74	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.4	-			
7 Y	2.57	-	7 Y	2.88	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.72	-	10Y	2.98	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.95	-3.00	3M Shibor	2.10	-	O-N Shibor	1.65	11.90	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	3	1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	-	3	-			
9M*1Y	1	-1	4	-1	6M	13	-
1*2Y	10	1	14	2	9M	15	-
1*3Y	22	1	27	2	1Y	18	-
1*4Y	34	2	41	1	2Y	22	1
1*5Y	43	1	54	1	3Y	23	1
2*3Y	12	-	13	-	4Y	25	-1
2*4Y	24	1	27	-1	5Y	29	-
2*5Y	33	-	40	-1			
3*4Y	12	1	14	-1			
3*5Y	21	-	27	-1			
4*5Y	9	-1	13	-			
5*7Y	12	-	14	-			
5*10Y	27	-	24	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	58	57	56	56	57	59	60
今日	58	57	56	56	57	59	60

Bond Swap	230002/5y repo	230004/5y repo	230203/5y repo	230205/5y repo
昨日	-5	21	7	36
今日	-6	21	6	36



联系人: Ruby Hu
邮箱: xiaoting.hu@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:
以上所述及所述的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知悉权属于上海国际证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际证券”) 或其三方。“信息”本身也不应被解释为与任何金融工具、投资策略任何交易策略相关的推介、定价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、及时性或准确性等要素, 且可未经通知而进行修改, 所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang