



【2023-07-27】

 中国人民银行今日开展 1140 亿元逆回购操作，因今日有 260 亿元逆回购到期，当日实现净投放 880 亿元。 资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 2.10%，较上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 2.0980%，较上一交易日下降 0.1bp。

 Repo 端，5y repo 早盘开在 2.48%，受期货震荡影响，最低成交至 2.475%，最高成交在 2.48%位置，成交区间在 2.475%-2.48%区间，午盘报收 47.75/47.5。午后，5y repo 成交在 2.475%，成交区间在 2.47%-2.48%区间附近，尾盘报收 48.25/47.75。1y repo 早盘开在 2.0225%，全天成交区间集中在 2.0175%-2.03%区间，尾盘报收 02.5/02.25。盘中，6m repo 成交在 1.9925%，2y repo 成交在 2.1175%-2.1275%，3y repo 成交在 2.2475%-2.26%，4y repo 成交在 2.3725%-2.3825%。曲线方面，6mx1y repo 成交在 02.75bp，1x2y repo spd 成交在 10bp，2x5y repo spd 成交在 35.5bp，3x4y repo spd 成交在 12.25-12.5bp，1x5y repo spd 成交在 45.5bp，报收 45.75/45.5。

 Shibor 端，1y shibor 成交在 2.20%附近，报收 20.5/20，2y shibor 成交在 2.3275%-2.325%附近，3y shibor 成交在 2.48%附近，5y shibor 报收 77.75/76.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 57.5/56.5。基差方面，1y basis 报收 18/17.75，2y basis 成交在 20.75bp 附近，5y basis 报收 29.5/29。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

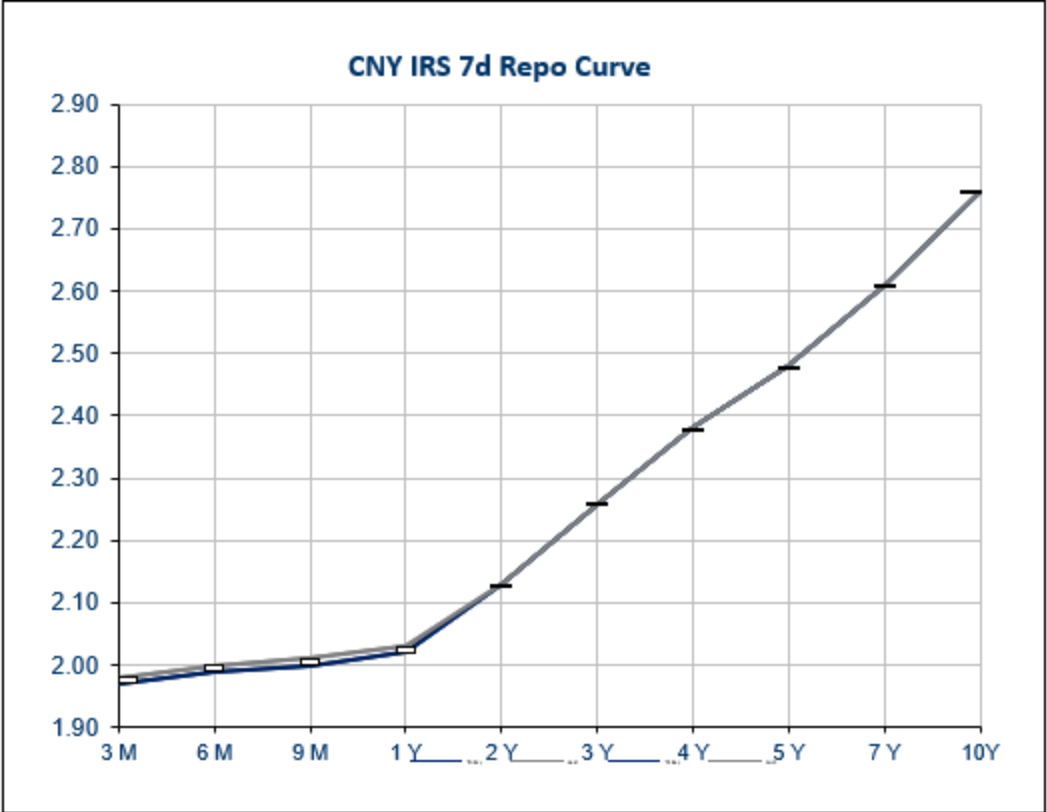
2023/7/27 星期四

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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp			
3 M	1.97	-1				3 M	1.59	-									
6 M	1.99	-1	6 M	2.13	-	6 M	1.51	-									
9 M	2	-1	9 M	2.17	-	9 M	1.51	-									
1 Y	2.02	-1	1 Y	2.2	-1	1 Y	1.6	-				1Y	2.01	-			
2 Y	2.13	-	2 Y	2.33	-2	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.1	-			
3 Y	2.26	-	3 Y	2.48	-2	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.23	-			
4 Y	2.38	-	4 Y	2.63	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.35	-			
5 Y	2.48	-	5 Y	2.77	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.44	-			
7 Y	2.61	-	7 Y	2.94	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.76	-	10Y	3.04	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.10	-5.00	3M Shibor	2.098	-0.10	O-N Shibor	1.396	-6.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS		SHIBOR-REPO	
3M*6M	2	-		Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	1	-	4	-			
9M*1Y	2	-	3	-1	6M	14	1
1*2Y	11	1	13	-1	9M	17	1
1*3Y	24	1	28	-1	1Y	18	-
1*4Y	36	1	43	-	2Y	20	-2
1*5Y	46	1	57	-	3Y	22	-
2*3Y	13	-	15	-	4Y	25	-1
2*4Y	25	-	30	1	5Y	29	-1
2*5Y	35	-	44	1			
3*4Y	12	-	15	1			
3*5Y	22	-	29	1			
4*5Y	10	-	14	-			
5*7Y	13	-	17	1			
5*10Y	28	-	27	1			

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	-6	18	7	35
今日	-7	18	5	34



联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的、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求, 且可未经通知而进行修改, 所有陈述和保证均经特此免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang