



【2023-04-17】

 中国央行今日开展 1700 亿元 1 年期中期借贷便利（MLF）操作和 200 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 1500 亿元 1 年期中期借贷便利（MLF）和 180 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 220 亿元。7d repo fixing: 2.20%，与上一交易日上行 10bp，3m shibor fixing: 2.4240%，与上一交易日上行 0.20bp。

 Repo 端，5y repo 早盘开在 2.835%后震荡上行至 2.8475%，午盘报收 84.5/84.25。午后回来，5y repo 率先 gvn2.845%后上行震荡，尾盘上行 tkn2.855%，报收 85.75/85.5。1y repo 率先 tkn2.3875%后震荡下行至 2.3825%附近，下午一路攀升成交在 2.385%-2.3975%，报收 39.75/39.25。盘中，2y repo 成交在 2.515%~2.52% 区间附近。3y repo 成交在 2.6475%。曲线方面，1x2y repo spd 成交在 13.5bp，3x5y repo spd 成交在 20bp, 1x5y repo spd 成交在 46bp，报收 46.5/45.75。

 Shibor 端，1y shibor 成交在 2.605%，报收 61.5/61。5y shibor 成交在 3.205%附近，报收 22.25/21.25。3y shibor 成交在 2.9375%附近。曲线方面，1x2y shibor 成交在 18.5bp 附近。基差方面，1y basis 报收 22.25/21.5；5y basis 成交在 35.75bp，报收 36.5/36。

 其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2023/4/17 Monday

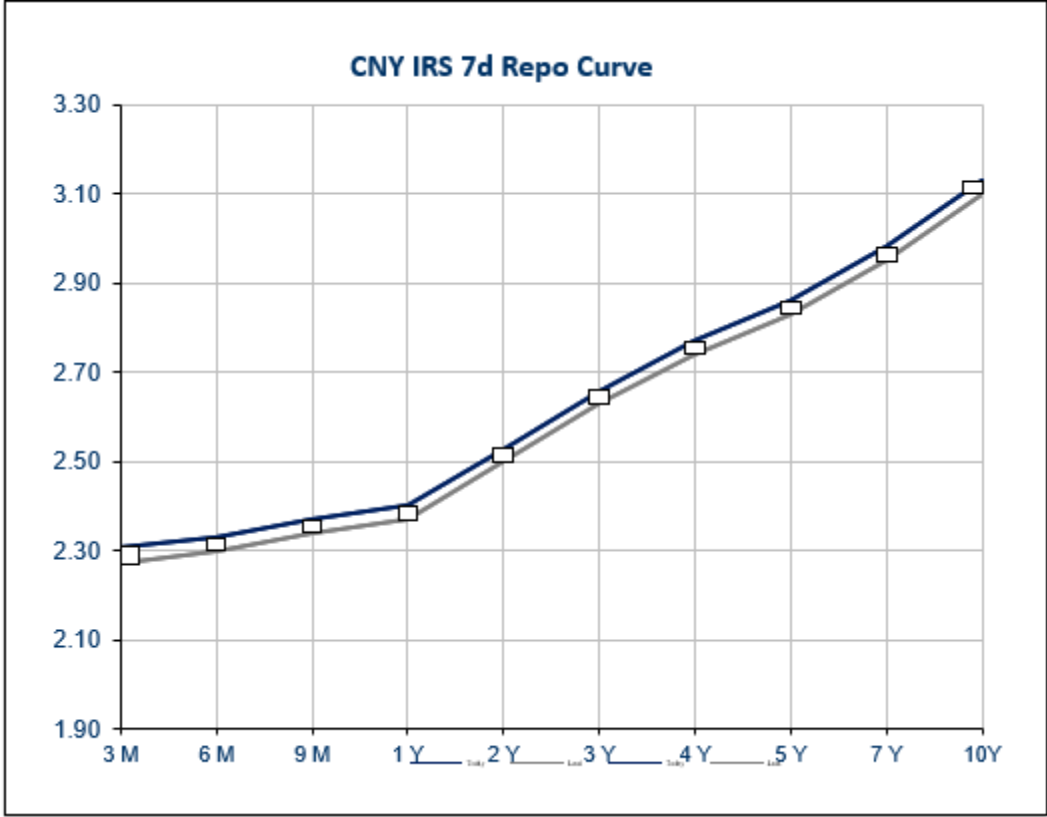
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.31	4				3 M	1.77	-						
6 M	2.33	3	6 M	2.49	1	6 M	1.89	-						
9 M	2.37	3	9 M	2.54	2	9 M	1.92	-						
1 Y	2.4	3	1 Y	2.61	1	1 Y	1.96	-				1Y	2.38	2
2 Y	2.53	3	2 Y	2.8	2	2 Y	1.98	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.51	2
3 Y	2.66	3	3 Y	2.96	3	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.64	3
4 Y	2.77	3	4 Y	3.1	3				4 Y	1.8	-	4Y	2.74	3
5 Y	2.86	3	5 Y	3.22	3				5 Y	1.8	-	5Y	2.83	3
7 Y	2.98	3	7 Y	3.35	3				7 Y	1.8	-			
10Y	3.13	3	10Y	3.48	3				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.20	10.00	3M Shibor	2.424	0.20	O-N Shibor	1.818	21.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	2	-1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	4	-	5	1			
9M*1Y	3	-	7	-1	6M	16	-2
1*2Y	13	-	19	1	9M	17	-1
1*3Y	26	-	35	2	1Y	21	-2
1*4Y	37	-	49	2	2Y	27	-1
1*5Y	46	-	61	2	3Y	30	-
2*3Y	13	-	16	1	4Y	33	-
2*4Y	24	-	30	1	5Y	36	-
2*5Y	33	-	42	1			
3*4Y	11	-	14	-			
3*5Y	20	-	26	-			
4*5Y	9	-	12	-			

5*7Y	12	-	13	-		
5*10Y	27	-	26	-		

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	69	68	68	68	70	72	73
今日	69	68	68	68	70	72	73

Bond Swap	230002/5y repo	220025/5y repo	230203/5y repo	220220/5y repo
昨日	-17	2	-1	19
今日	-19	1	-2	18



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Wu
邮箱: xiacoting.bu@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:

以上所述及附送的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或专有的信息, 其知识产仅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推介、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、及时性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均按明说免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN