



【2023-04-21】

中国央行今日开展 880 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 150 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 730 亿元。7d repo fixing: 2.50%，比上一交易日上升 35bp。3m shibor fixing: 2.4290，较上一交易日持平。

Repo 端，早盘 5y repo gvn 在 2.845%后震荡成交在 2.8425%-2.85%区间附近。午盘报收 85/84.5。午后回来，期货期货大浮动上行，5y repo tkn 在 2.845%后震荡下行成交至 2.8375%附近，尾盘报收 84/83.75。1y repo tkn 在 2.3825%后震荡成交在 2.38%-2.3925%附近，报收 38.75/38.50。2y repo 成交在 2.52%、2.51%附近。曲线方面，1x5y repo spd 成交在 45.5bp、45.75bp 附近，报收 45.75/45.25。

shibor 端，5y shibor 报收 20.75/20。1y shibor 成交在 2.585%-2.595%区间附近，报收 59.5/58.75。2y shibor 成交在 2.775%、2.7775%附近。曲线方面，1x2y shibor spd 成交在 18.25bp。1x5y shibor 报收 62.5/60.5。Basis 方面，1y basis 成交在 20bp、20.25bp，报收 20.75/20。5y basis 报收 36.75/36。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

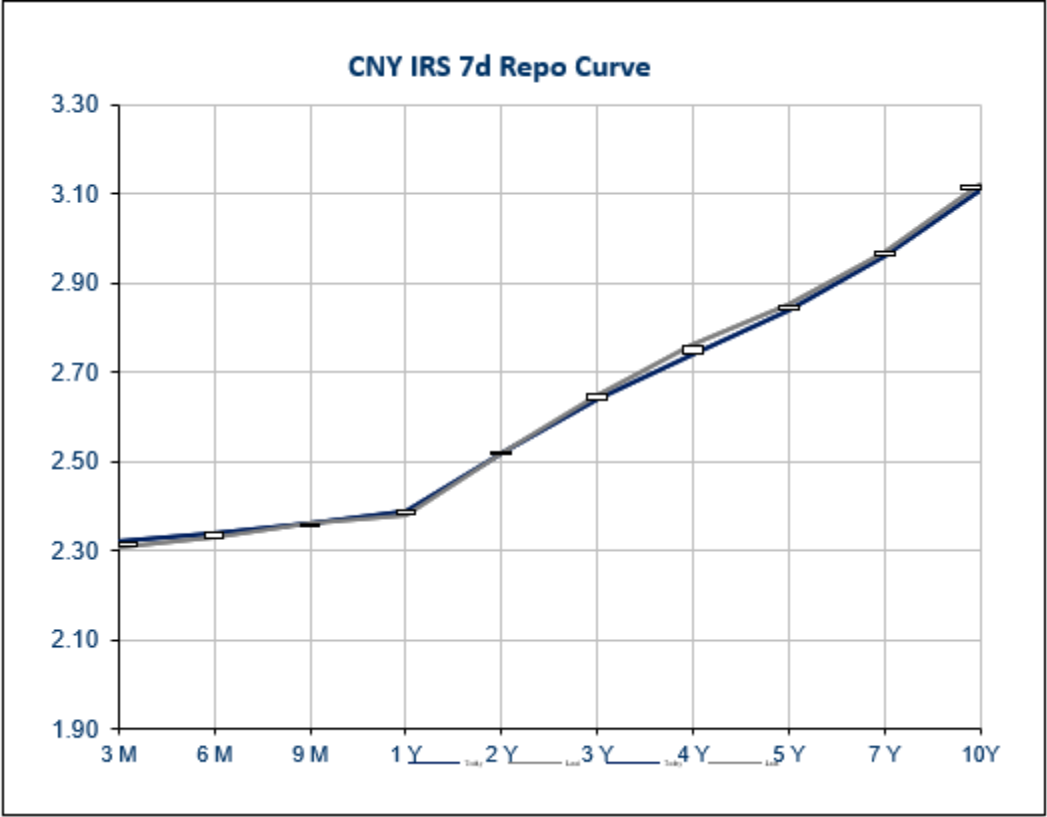
2023/4/21 Friday

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	2.32	1				3 M	1.77	-						
6 M	2.34	1	6 M	2.48	1	6 M	1.89	-						
9 M	2.36	-	9 M	2.53	1	9 M	1.92	-						
1 Y	2.39	1	1 Y	2.59	-	1 Y	1.96	-				1Y	2.38	-
2 Y	2.52	-	2 Y	2.78	-	2 Y	1.98	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.51	-
3 Y	2.64	-1	3 Y	2.93	-	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.63	-1
4 Y	2.74	-2	4 Y	3.07	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.73	-1
5 Y	2.84	-1	5 Y	3.2	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.82	-1
7 Y	2.96	-1	7 Y	3.33	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	3.11	-1	10Y	3.46	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.50	35.00	3M Shibor	2.429	-	O-N Shibor	2.272	6.50	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	2	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	2	-1	5	-				
9M*1Y	3	1	6	-1	6M	14	-	
1*2Y	13	-1	19	-	9M	17	1	
1*3Y	25	-2	34	-	1Y	20	-1	
1*4Y	35	-3	48	-1	2Y	26	-	
1*5Y	45	-2	61	-1	3Y	29	1	
2*3Y	12	-1	15	-	4Y	33	1	
2*4Y	22	-2	29	-1	5Y	36	-	
2*5Y	32	-1	42	-1				
3*4Y	10	-1	14	-1				
3*5Y	20	-	27	-1				
4*5Y	10	1	13	-				
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	-18	0	-3	18
今日	-18	1	-3	18



文 / Joyce Zhang

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:

以上所述及附带的信息 (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、投资策略或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订。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN