



【2023-03-22】

中国央行今日进行 670 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 2.00%，与此前持平。今日有 1040 亿元逆回购到期。资金面整体偏松。7d repo fixing：2.3%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 2.4790%，与上一交易日下降 0.8bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.835%附近，后震荡成交在 2.835%-2.845%区间附近，午盘报收 84.25/84。中午回来，5y repo 稍微震荡下行，成交在 2.84%-2.825%区间附近，报收 82.75/82.25。1y repo 全天随长端震荡成交在 2.3875%-2.375%区间附近，报收 37.75/37.5。其他期限，1m repo 成交在 2.335%区间附近，3m repo 成交在 2.335%-2.34%区间附近，6m repo 成交在 2.3325%-2.34%区间附近，9m repo 成交在 2.355%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 01.75bp 附近，9mx1y repo 成交在 03bp 附近，1x5y repo 成交在 45.25bp 附近，报收 45.25/45。

Shibor 端，9m shibor 成交在 2.555%区间附近，1y shibor 成交在 2.63%-2.635%附近，报收 62.5/62，5y shibor 报收 22.75/22。曲线方面，9mx1y shibor 成交在 08bp 附近，基差方面，1y basis 成交在 25-25.25bp 附近，报收 25/24.25，5y basis 报收 40/39.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/3/22 Wednesday

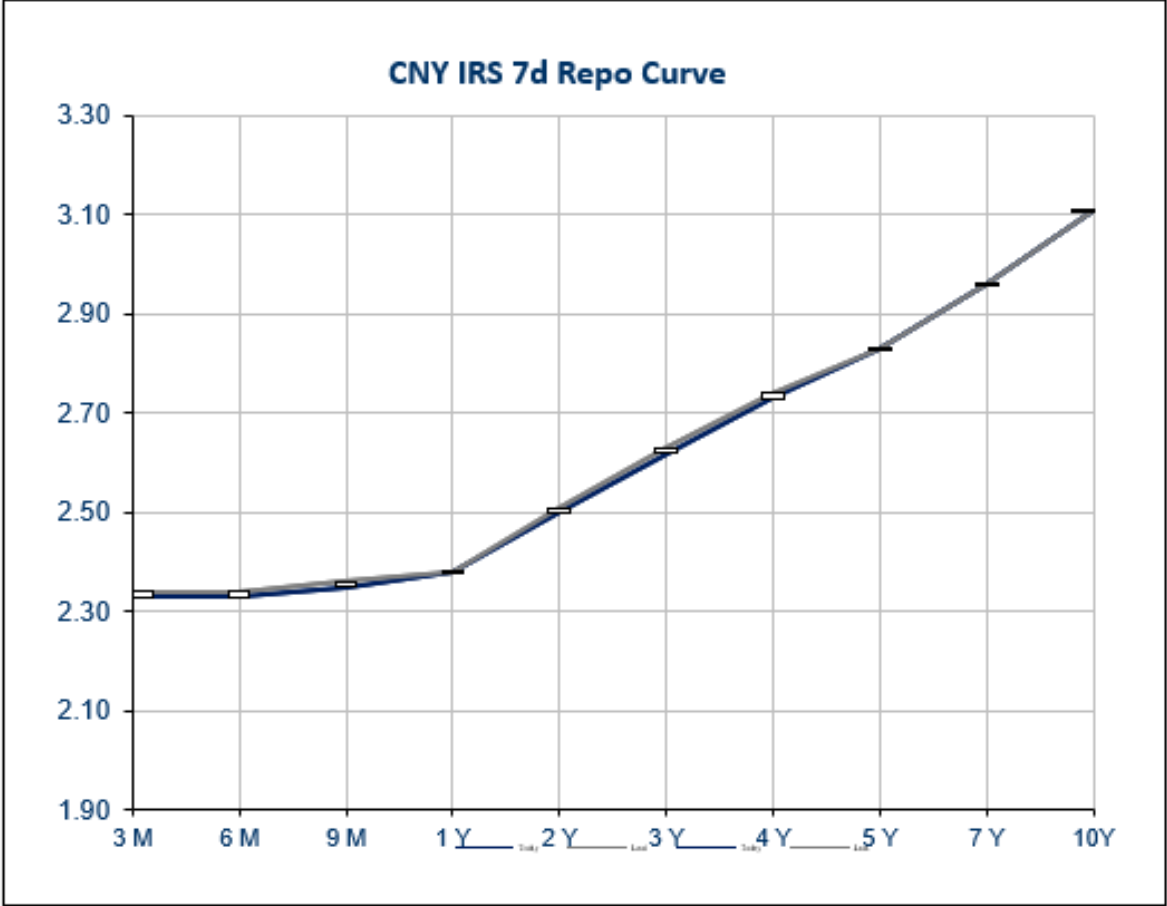
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.33	-1				3 M	1.7	-						
6 M	2.33	-1	6 M	2.52	-2	6 M	1.9	-						
9 M	2.35	-1	9 M	2.54	-2	9 M	1.92	-						
1 Y	2.38	-	1 Y	2.62	-2	1 Y	2.01	-				1Y	2.37	-
2 Y	2.5	-1	2 Y	2.82	-1	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.5	-
3 Y	2.62	-1	3 Y	2.96	-2	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.62	-1
4 Y	2.73	-1	4 Y	3.1	-2				4 Y	1.8	-	4Y	2.72	-
5 Y	2.83	-	5 Y	3.22	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.8	-1
7 Y	2.96	-	7 Y	3.36	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	3.11	-	10Y	3.49	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.30	-5.00	3M Shibor	2.479	-0.80	O-N Shibor	2.024	-43.50	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	0	-			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	2	-	2	-			
9M*1Y	3	1	8	-	6M	19	-1
1*2Y	12	-1	20	1	9M	19	-1
1*3Y	24	-1	34	-	1Y	24	-2
1*4Y	35	-1	48	-	2Y	32	-

1*5Y	45	-	60	1	3Y	34	-1
2*3Y	12	-	14	-1	4Y	37	-1
2*4Y	23	-	28	-1	5Y	39	-1
2*5Y	33	1	40	-			
3*4Y	11	-	14	-			
3*5Y	21	1	26	1			
4*5Y	10	1	12	1			
5*7Y	13	-	14	-			
5*10Y	28	-	27	-			

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	-14	8	1	25
今日	-16	5	-1	21



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Bu

邮箱: xiaoting.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:

以上所登及链接的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的利/或者专用的信息。其知识产权属于上海国新货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国新货币”）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、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、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