



【2023-04-24】

中国央行今日开展 1150 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 200 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 950 亿元。资金面均衡。7d repo fixing: 2.55%，与上一交易日增加 45bp。3m shibor fixing: 2.43%，比上一交易日增加 0.1bp。

Repo 端，早盘 5y repo gvn 在 2.83%后震荡成交在 2.8225%-2.83%区间附近。午盘报收 83/82.75。午后，5y repo 成交在 2.8275%附近，期货尾盘大幅下行，5y repo 上行 tkn 至 2.8325%后成交在 2.8275%-2.8325%附近。尾盘报收 83.25/83。1y repo 成交在 2.3725%-2.3875%区间附近，报收 38.75/38.5。2y repo 成交在 2.50%、2.5075%。曲线方面 1x2y repo spd 成交在 12.25bp。1x5y repo spd 报收 44.5/44。

Shibor 端，1y shibor tkn 在 2.585%、2.5875%，报收 59.25/58.75。5y shibor 尾盘 gvn 在 3.19%，报收 19/18.75。2y shibor gvn 2.7675%后 tkn 在 2.77%。曲线方面，1x2y shibor spd 成交在 18.25bp、17.75bp。1x5y shibor spd 报收 60.25/59.5。Basis 方面，1y s/r basis 报收 20.5/20。5y s/r basis 报收 36.25/35.75。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/4/24 Monday

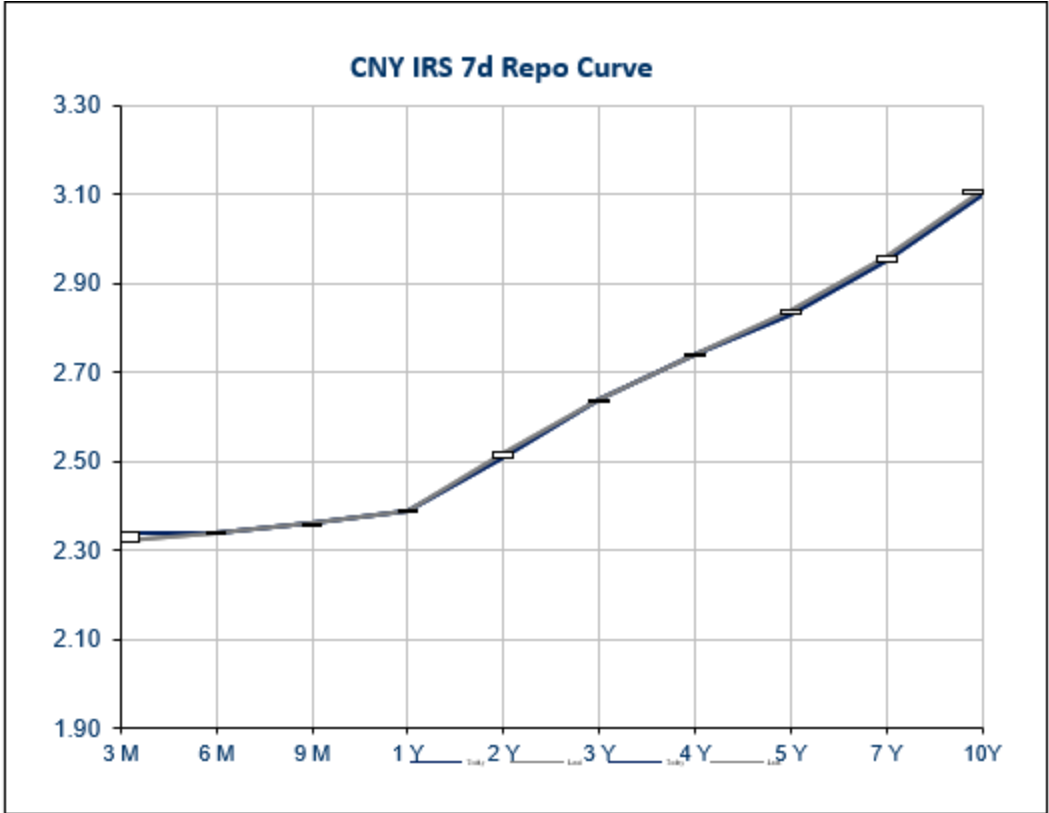
ONSHORE IRS		Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd										OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	2.34	2				3 M	1.77	-						
6 M	2.34	-	6 M	2.49	1	6 M	1.89	-						
9 M	2.36	-	9 M	2.53	-	9 M	1.92	-						
1 Y	2.39	-	1 Y	2.59	-	1 Y	1.96	-				1Y	2.38	-
2 Y	2.51	-1	2 Y	2.77	-1	2 Y	1.98	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.5	-1
3 Y	2.64	-	3 Y	2.92	-1	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.62	-1
4 Y	2.74	-	4 Y	3.07	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.71	-2
5 Y	2.83	-1	5 Y	3.19	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.8	-2
7 Y	2.95	-1	7 Y	3.33	-				7 Y	1.8	-			
10Y	3.1	-1	10Y	3.46	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.55	45.00	3M Shibor	2.43	0.10	O-N Shibor	1.599	-20.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0	-2			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	2	-	4	-1				
9M*1Y	3	-	6	-	6M	15	1	
1*2Y	12	-1	18	-1	9M	17	-	
1*3Y	25	-	33	-1	1Y	20	-	
1*4Y	35	-	48	-	2Y	26	-	
1*5Y	44	-1	60	-1	3Y	28	-1	
2*3Y	13	1	15	-	4Y	33	-	
2*4Y	23	1	30	1	5Y	36	-	
2*5Y	32	-	42	-				
3*4Y	10	-	15	1				
3*5Y	19	-1	27	-				
4*5Y	9	-1	12	-1				
5*7Y	12	-	14	1				
5*10Y	27	-	27	1				

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	230002/5y	220025/5y	230203/5y	220220/5y
Swap	repo	repo	repo	repo

昨日	-18	1	-3	18
今日	-18	0	-2	18



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Su
邮箱: xlouting.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:

以上所发及附加的所有信息 (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际货币经纪有限公司 (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、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标准免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN