



【2023-07-26】

中国央行今日进行 1040 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.90%，与此前持平。今日有 250 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing: 2.15%，与上一交易日相比不变，3m shibor fixing: 2.0990%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.52%附近，后震荡下行，在 2.52%-2.5025%区间附近震荡成交，午盘报收 51/50.75。中午回来，国债期货震荡上行，5y repo 继续下行，震荡成交在 2.505%-2.4925%区间附近，期货收盘后，5y 继续震荡向下，成交在 2.49%-2.485%附近，尾盘报收 48.5/48.25。1y repo 全天随长端震荡成交在 2.0625%-2.03%区间附近，尾盘报收 03/02.75。其他期限，9m repo 成交在 2.0325%附近，2y repo 成交在 2.1575%-2.1425%区间附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在 01.75bp 附近，1x2y repo 成交在 10bp 附近，2x5y repo 成交在 35.75bp 附近，1x5y repo 成交在 45.75-45.5bp 附近，报收 45.75/45.25。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.23%附近，报收 21.25/20.5，5y shibor 报收 78.25/77.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 57.75/56.75。基差方面，1y basis 报收 18.25/17.75，5y basis 报收 30/29.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

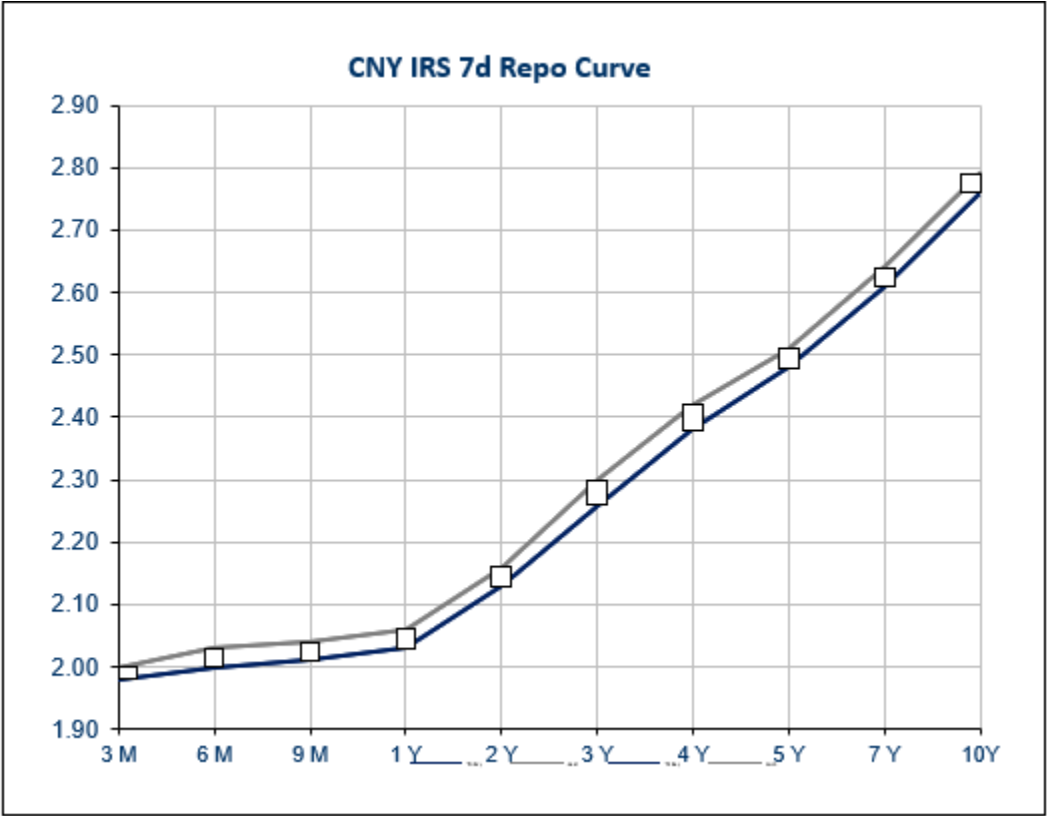
2023/7/26 Wednesday

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	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.98	-2				3 M	1.59	-						
6 M	2	-3	6 M	2.13	-3	6 M	1.51	-1						
9 M	2.01	-3	9 M	2.17	-3	9 M	1.51	-5						
1 Y	2.03	-3	1 Y	2.21	-4	1 Y	1.6	1				1Y	2.01	-3
2 Y	2.13	-3	2 Y	2.35	-3	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.1	-3
3 Y	2.26	-4	3 Y	2.5	-3	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.23	-4
4 Y	2.38	-4	4 Y	2.64	-4				4 Y	1.8	-	4Y	2.35	-3
5 Y	2.48	-3	5 Y	2.78	-3				5 Y	1.8	-	5Y	2.44	-3
7 Y	2.61	-3	7 Y	2.94	-3				7 Y	1.8	-			
10Y	2.76	-3	10Y	3.04	-3				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.15	-	3M Shibor	2.099	-0.10	O-N Shibor	1.459	-5.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	2	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	-	4	-				
9M*1Y	2	-	4	-1	6M	13	-	
1*2Y	10	-	14	1	9M	16	-	
1*3Y	23	-1	29	1	1Y	18	-1	
1*4Y	35	-1	43	-	2Y	22	-	
1*5Y	45	-	57	1	3Y	24	-	
2*3Y	13	-1	15	-	4Y	26	-	
2*4Y	25	-1	29	-1	5Y	30	-	
2*5Y	35	-	43	-				
3*4Y	12	-	14	-1				
3*5Y	22	1	28	-				
4*5Y	10	1	14	1				
5*7Y	13	-	16	-				
5*10Y	28	-	26	-				

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	34
今日	-6	19	6	35



联系人: Ruby Hu
邮箱: rubyhu@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:
以上所登及附登的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供口提供信息, 且为保密的私/或者专用的信息, 其知识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素, 且可能随时通知而进行修订, 所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang