



【2023-04-12】

 中国央行今日进行 70 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 2.00%，与此前持平。今日无逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing：2.10%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 2.4180%，与上一交易日上升 0.3bp。

 Repo 端，5y repo 全天窄幅震荡，成交在 2.82%-2.81%区间附近，报收 81.75/81.5。1y repo 全天震荡成交在 2.3675%-2.3725%区间附近，报收 37/36.75。其他期限，2y repo 成交在 2.4975%-2.50%区间附近，3y repo 成交在 2.6275%-2.6225%附近。曲线方面，3x5y repo 成交在 19.25bp 附近，1x5y repo 成交在 44.75bp 附近，报收 45/44.5。

 Shibor 端，2y shibor 成交在 2.785%附近，1y shibor 报收 59.5/58.75，5y shibor 报收 20.25/19.25。基差方面，2y basis 成交在 28.5bp 附近，1y basis 报收 22.75/22，5y basis 报收 38.5/37.5

 Lpr 端，2y LPR_5y 成交在 4.395%附近，报收 39.5/38。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

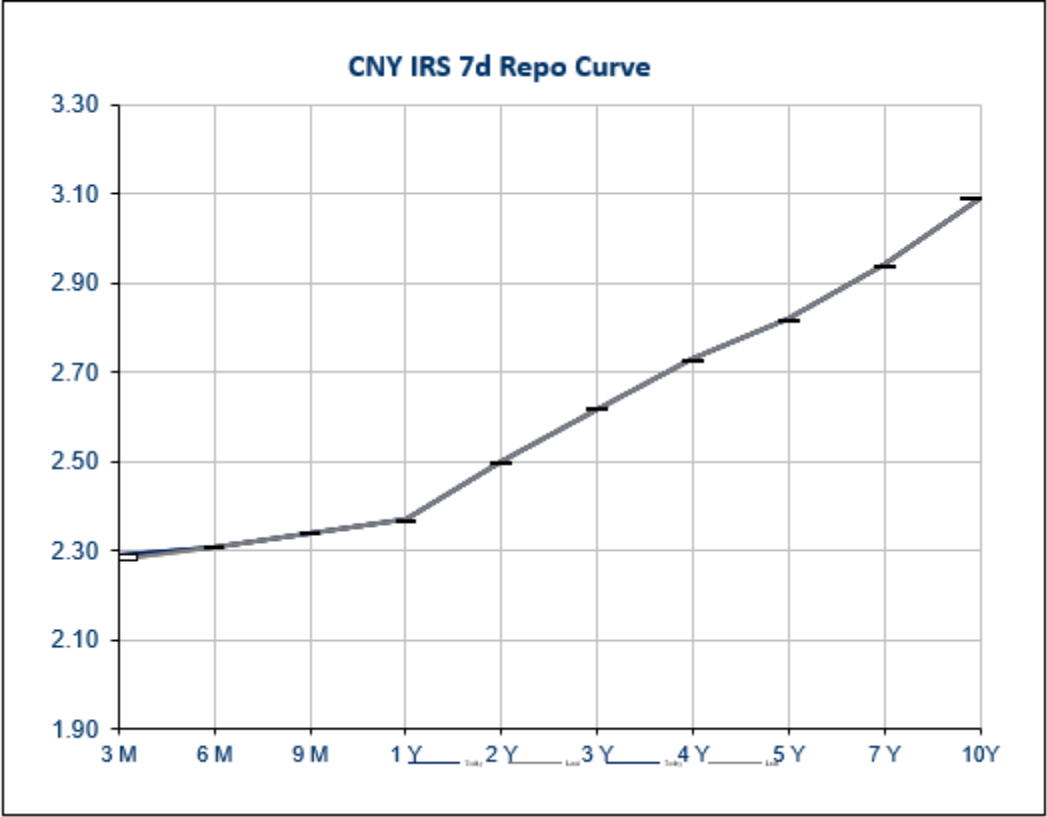
2023/4/12 Wednesday

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	2.29	1				3 M	1.77	-						
6 M	2.31	-	6 M	2.48	-	6 M	1.89	-						
9 M	2.34	-	9 M	2.52	-1	9 M	1.92	-						
1 Y	2.37	-	1 Y	2.59	-	1 Y	1.96	-				1Y	2.36	-
2 Y	2.5	-	2 Y	2.79	-	2 Y	1.98	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.49	-
3 Y	2.62	-	3 Y	2.93	-	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.61	-
4 Y	2.73	-	4 Y	3.07	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.7	-
5 Y	2.82	-	5 Y	3.2	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.78	-1
7 Y	2.94	-	7 Y	3.33	-				7 Y	1.8	-			
10Y	3.09	-	10Y	3.46	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.10	-5.00	3M Shibor	2.418	0.30	O-N Shibor	1.39	-3.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	2	-1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	3	-	4	-1				
9M*1Y	3	-	7	1	6M	17	-	
1*2Y	13	-	20	-	9M	18	-1	
1*3Y	25	-	34	-	1Y	22	-	
1*4Y	36	-	48	-	2Y	29	-	
1*5Y	45	-	61	-	3Y	31	-	
2*3Y	12	-	14	-	4Y	34	-	
2*4Y	23	-	28	-	5Y	38	-	
2*5Y	32	-	41	-				
3*4Y	11	-	14	-				
3*5Y	20	-	27	-				
4*5Y	9	-	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	-17	2	-1	19
今日	-17	2	-2	19



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:

以上所登及列出的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国脉货币”) 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、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, 所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN