



【2023-04-19】

中国央行今日开展 320 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 70 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 250 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 2.15%，比上一交易日下降 10bp。3m shibor fixing: 2.4320%，较上一交易日上升 0.60bp。

Repo 端，早盘 5y repo 率先 gvn 在 2.835%后震荡成交在 2.8325%-2.8375%附近，午盘报收 83.5/83.25。午后回来，5y repo 上行成交在 2.8375%-2.8475%附近，报收 84.5/84.25。早盘 1y repo 成交在 2.375%-2.38%附近，报收 38/37.75。午后，1y repo 成交在 2.3775%-2.38%区间附近，报收 38.25/37.75。3y repo 成交在 2.6425%。曲线方面，1x5y repo 成交在 45.5bp，报收 46.75/46.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.5925%-2.5975%附近，报收 60.25/59.50。5y shibor 报收 21.75/20.75。2y shibor 成交在 2.775%-2.78%附近。曲线方面，1x2y shibor 成交在 18.25bp、18bp 附近。Basis 方面，1y basis 报收 22/21.5。5y basis 报收 37/36.25。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

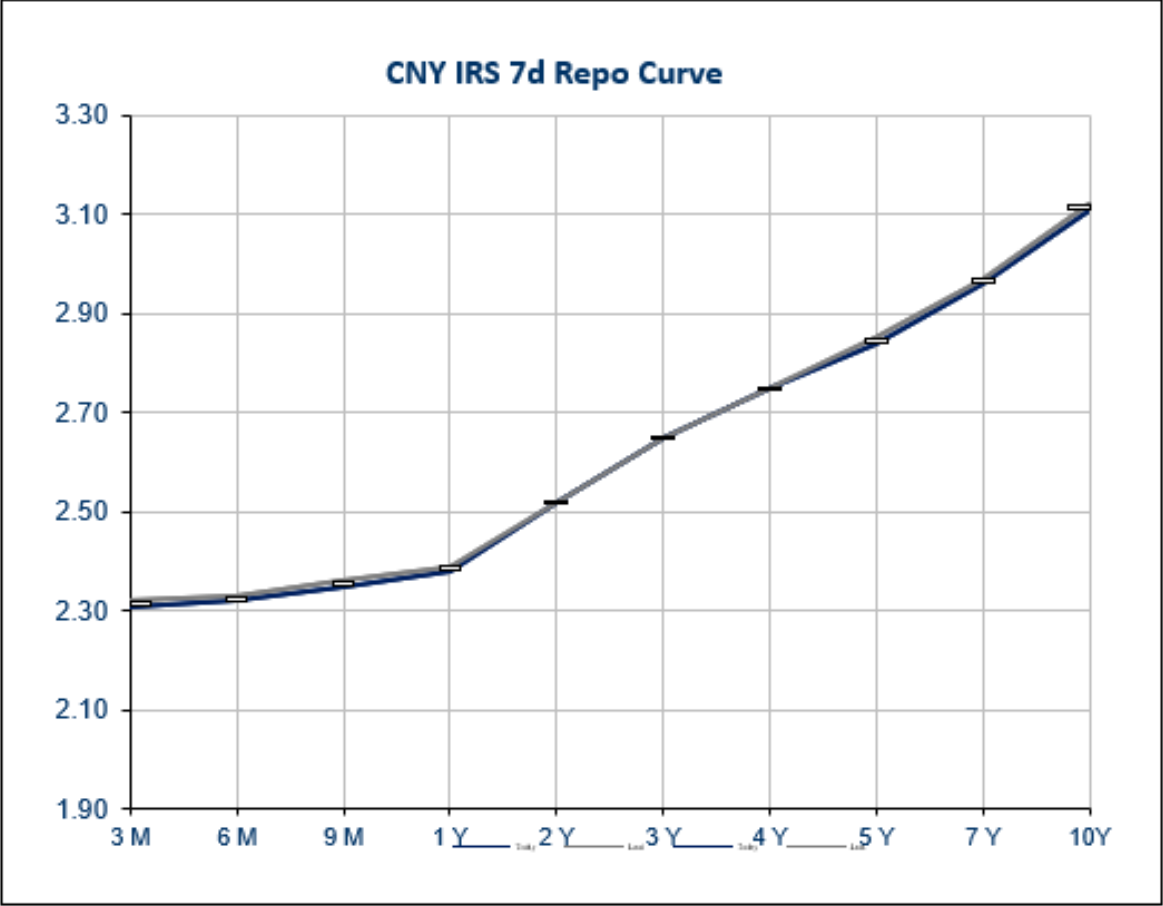
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2023/4/19 Wednesday

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd												OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-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	2.31	-1				3 M	1.77	-									
6 M	2.32	-1	6 M	2.49	1	6 M	1.89	-									
9 M	2.35	-1	9 M	2.53	-	9 M	1.92	-									
1 Y	2.38	-1	1 Y	2.6	-	1 Y	1.96	-				1Y	2.37	-1			
2 Y	2.52	-	2 Y	2.78	-	2 Y	1.98	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.5	-1			
3 Y	2.65	-	3 Y	2.94	1	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.63	-1			
4 Y	2.75	-	4 Y	3.08	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.73	-			
5 Y	2.84	-1	5 Y	3.21	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.82	-			
7 Y	2.96	-1	7 Y	3.34	-				7 Y	1.8	-						
10Y	3.11	-1	10Y	3.47	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.15	-10.00	3M Shibor	2.432	0.60	0-N Shibor	2.13	8.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	1	-			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	3	-	4	-1			
9M*1Y	3	-	7	-	6M	17	2
1*2Y	14	1	18	-	9M	18	1
1*3Y	27	1	34	1	1Y	22	1
1*4Y	37	1	48	-	2Y	26	-
1*5Y	46	-	61	-	3Y	29	1
2*3Y	13	-	16	1	4Y	33	-
2*4Y	23	-	30	-	5Y	37	1
2*5Y	32	-1	43	-			
3*4Y	10	-	14	-1			
3*5Y	19	-1	27	-1			
4*5Y	9	-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	1	-2	18
今日	-18	1	-3	18



文 /JoyceZhang

联系人: Ruby Yu
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:

以上所述及附带的的所有信息 (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际货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际货币”) 或其三方, “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, 所有前述和保证均经特此免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN