



【2023-04-10】

中国人民银行今日开展 7 天期 180 亿元逆回购操作，因今日有 20 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 160 亿元。资金面方面整体均衡。7d repo fixing: 2.10%，与上一交易日下降 10bp。3m shibor fixing: 2.414%，比上一交易日上升 0.4bp。

今日，5y repo 开盘在 2.84%，后一路 tkn 至 2.855%，主要成交在 2.85%，2.855%附近，午盘报收 85.75/85.5。午后回来，5y repo 下行震荡成交在 2.855%-2.85%后回到 2.855%，报收 85.5/85.25。1y repo 随长端震荡成交在 2.38%-2.39%，报收 39/38.75。盘中 2y repo trd 2.5225%；3y repo trd 2.655%；4y repo 成交在 2.7575%。曲线方面，2x5y repo spd 成交在 33-32.75bp，1x5y repo spd 成交在 46.5bp，报收 46.5/46.25。

Shibor 方面，5y shibor 报收 24.5/23.25。1y shibor 成交在 2.61%，报收 61.25/60.5。9m shibor 成交在 2.525%。Basis 方面，1y s/r basis 成交在 22.25bp，报收 22.25/21.5。5y s/r basis 报收 39.25/38。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

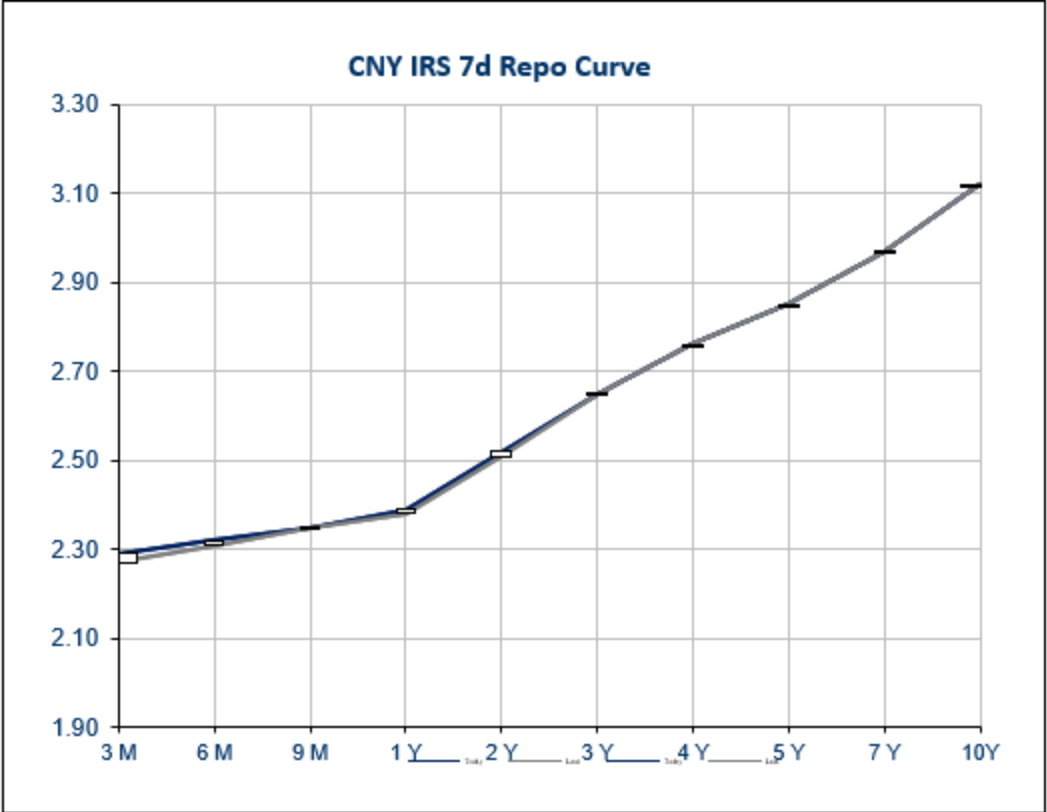
2023/4/10 Monday

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	2.29	2				3 M	1.77	-									
6 M	2.32	1	6 M	2.48	1	6 M	1.89	-									
9 M	2.35	-	9 M	2.53	1	9 M	1.92	-									
1 Y	2.39	1	1 Y	2.61	1	1 Y	1.96	-				1Y	2.39	1			
2 Y	2.52	1	2 Y	2.8	1	2 Y	1.98	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.52	1			
3 Y	2.65	-	3 Y	2.96	-	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.65	-			
4 Y	2.76	-	4 Y	3.11	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.76	1			
5 Y	2.85	-	5 Y	3.24	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.85	1			
7 Y	2.97	-	7 Y	3.37	1				7 Y	1.8	-						
10Y	3.12	-	10Y	3.5	1				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.10	-10.00	3M Shibor	2.414	0.40	O-N Shibor	1.324	-5.00	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	3	-1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	3	-1	5	-			
9M*1Y	4	1	8	-	6M	16	-
1*2Y	13	-	19	-	9M	18	1
1*3Y	26	-1	35	-1	1Y	22	-
1*4Y	37	-1	50	-1	2Y	28	-
1*5Y	46	-1	63	-	3Y	31	-
2*3Y	13	-1	16	-1	4Y	35	-
2*4Y	24	-1	31	-1	5Y	39	1
2*5Y	33	-1	44	-			
3*4Y	11	-	15	-			
3*5Y	20	-	28	1			
4*5Y	9	-	13	1			
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	2	-3	19
今日	-19	1	-4	18



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。所有保证和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN