



【2023-04-07】

中国央行今日开展 7 天期 170 亿元逆回购操作，因今日有 1890 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1720 亿元。资金面方面整体均衡。7d repo fixing: 2.20%，与上一交易日增加 5bp。3m shibor fixing: 2.410%，比上一交易日减少 0.4bp。

今日，5y repo 早盘震荡成交在 2.87%-2.88%。午后回来，5y repo 下行成交在 2.87%-2.865%。后期货上行，5y repo 大幅下行 gvn 在 2.8475%-2.84%区间震荡成交。1y repo 开盘成交在 2.395%-2.40%，后下行成交在 2.3775%-2.3725%区间成交。盘中 2y repo trd 2.535%；3y repo trd 2.66%；4y repo 成交在 2.785%。曲线方面，1mx3m repo spd 成交在 3.5bp；6mx9m repo spd trd 3.75bp；1x2y repo spd 成交在 14bp；1x4y repo spd 成交在 38.75bp；1x5y repo spd 成交在 47.25-48bp；3x4y repo spd trd 11bp；4x5y repo spd 成交在 9.5bp。

Shibor 方面，5y shibor 报收 23.5/22.5。1y shibor 成交在 2.625%。9m shibor 成交在 2.53%；6m shibor 成交在 2.475%。曲线方面，9mx1y shibor spd 成交在 9.5bp。Basis 方面，1y s/r basis 报收 22.75/22；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
2023/4/7 Friday

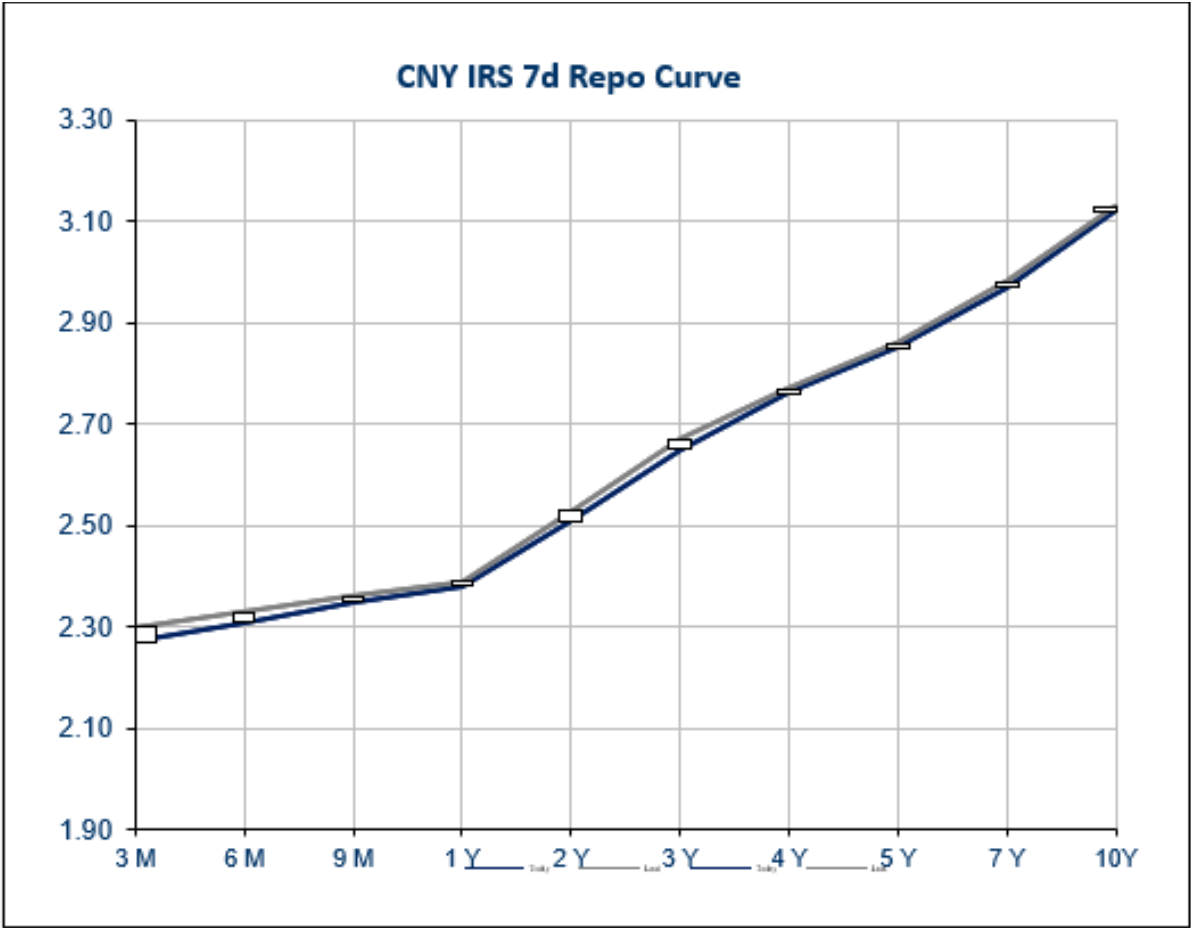
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365		
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	2. 27	-3				3 M	1. 77	-						
6 M	2. 31	-2	6 M	2. 47	-1	6 M	1. 89	-						
9 M	2. 35	-1	9 M	2. 52	-1	9 M	1. 92	-						
1 Y	2. 38	-1	1 Y	2. 6	-2	1 Y	1. 96	-				1Y	2. 38	-1
2 Y	2. 51	-2	2 Y	2. 79	-3	2 Y	1. 98	-	2 Y	1. 65	-	2Y	2. 51	-2
3 Y	2. 65	-2	3 Y	2. 96	-2	3 Y	2. 05	-	3 Y	1. 77	-	3Y	2. 65	-2
4 Y	2. 76	-1	4 Y	3. 11	-1				4 Y	1. 8	-	4Y	2. 75	-1
5 Y	2. 85	-1	5 Y	3. 23	-1				5 Y	1. 8	-	5Y	2. 84	-1
7 Y	2. 97	-1	7 Y	3. 36	-1				7 Y	1. 8	-			
10Y	3. 12	-1	10Y	3. 49	-1				10Y	1. 8	-			
7D REPO	2. 20	5. 00	3M Shibor	2. 41	-0. 40	0-N Shibor	1. 374	3. 40	1Y DEPO	1. 50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	4	1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	4	1	5	-			
9M*1Y	3	-	8	-1	6M	16	1
1*2Y	13	-1	19	-1	9M	17	-
1*3Y	27	-1	36	-	1Y	22	-1
1*4Y	38	-	51	1	2Y	28	-1
1*5Y	47	-	63	1	3Y	31	-
2*3Y	14	-	17	1	4Y	35	-
2*4Y	25	1	32	2	5Y	38	-

2*5Y	34	1	44	2		
3*4Y	11	1	15	1		
3*5Y	20	1	27	1		
4*5Y	9	-	12	-		
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	-18	2	-3	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点评及更多资讯

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、股票或任何交易策略相关的报价、定价、建议或诱导。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其真实性、时效性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经严格免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN