

收盘日评 银行间利率衍生品市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2023-02-24】

中国人民银行今日开展 4700 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 8350 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 3650 亿元。资金面方面整体均衡。7d repo fixing: 2.60%，与上一交易日保持不变。3m shibor fixing: 2.4160%，比上一交易日增加 1bp。

今日，5y repo 开盘成交在 2.945%-2.9375%，后期货上行，5y repo gvn 在 2.935%-2.9325% 区间成交。午后回来，5y repo 震荡成交在 2.9325%-2.9375%。1y repo 成交在 2.42%-2.41%。尾盘利率下行，5y repo 收在 93.5/93.25, 1y repo 收在 41.5/41.25。盘中 6m repo 成交在 2.34%-2.35%；2y repo trd 2.57%-2.575%，2y repo trd 2.7225%。曲线方面，1x2y repo spd 成交在 15.75-16bp；1x5y repo spd trd 52.5-51.75bp；3x5y repo spd 成交在 21.5-21.75bp。

Shibor 方面，5y shibor 成交在 3.37%-3.38%。1y shibor 成交在 2.7075%-2.72%。2y shibor trd 2.91%。曲线方面，1x5y shibor spd 成交在 66bp。Basis 方面，1y s/r basis 成交在 29.5bp；2y s/r basis 成交在 34bp；5y s/r basis 报收 43.5/42.75。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

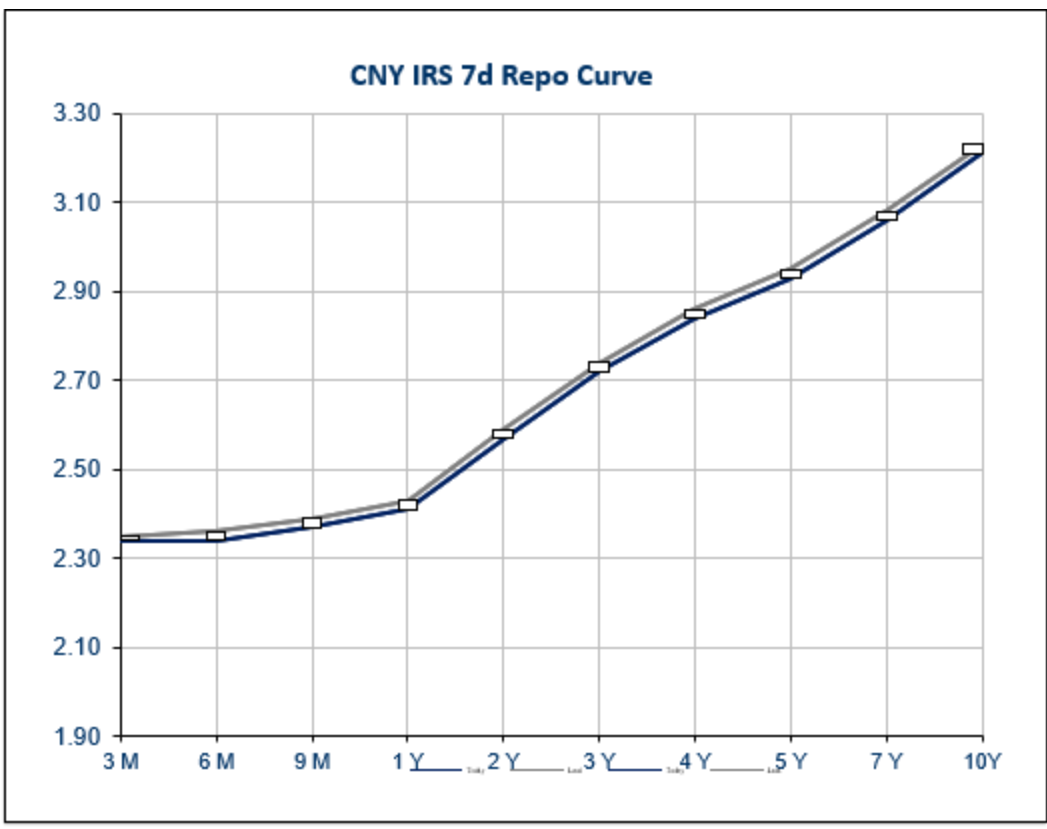
2023/2/24 Friday

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	2.34	-1				3 M	1.57	-						
6 M	2.34	-2	6 M	2.53	-2	6 M	1.75	-						
9 M	2.37	-2	9 M	2.6	-3	9 M	1.82	-						
1 Y	2.41	-2	1 Y	2.71	-2	1 Y	1.96	-				1Y	2.42	-1
2 Y	2.57	-2	2 Y	2.91	-3	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.58	-1
3 Y	2.72	-2	3 Y	3.07	-3	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.72	-2
4 Y	2.84	-2	4 Y	3.23	-2				4 Y	1.8	-	4Y	2.84	-2
5 Y	2.93	-2	5 Y	3.36	-2				5 Y	1.8	-	5Y	2.93	-2
7 Y	3.06	-2	7 Y	3.52	-2				7 Y	1.8	-			
10Y	3.21	-2	10Y	3.66	-2				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.60	-	3M Shibor	2.416	1.00	O-N Shibor	1.433	-4.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
			Tenor	Mid	Δ bp	
3M*6M	0	-1				
6M*9M	3	-	7	-1		
9M*1Y	4	-	11	1	6M	19
1*2Y	16	-	20	-1	9M	23
1*3Y	31	-	36	-1	1Y	30
1*4Y	43	-	52	-	2Y	34
1*5Y	52	-	65	-	3Y	35
2*3Y	15	-	16	-	4Y	39
2*4Y	27	-	32	1	5Y	43
2*5Y	36	-	45	1		
3*4Y	12	-	16	1		
3*5Y	21	-	29	1		
4*5Y	9	-	13	-		
5*7Y	13	-	16	-		
5*10Y	28	-	30	-		

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	220022/5y repo	220019/5y repo	220203/5y repo	220220/5y repo
昨日	-25	-2	-4	15
今日	-24	-2	-2	16



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Wu
 邮箱: xiaoting.wu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



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、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。所有风险和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN