



【2023-03-24】

中国央行今日开展 70 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 1800 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1730 亿元。资金面方面整体均衡。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日减少 30bp。3m shibor fixing: 2.4730%，比上一交易日减少 0.3bp。

今日，5y repo 早间震荡成交在 2.845%-2.8375%。午后回来，期货震荡下行，5y repo 震荡成交在 2.855%-2.845%区间。临近尾盘 利率下行 5y repo 成交在 2.8375%-2.8325%。1y repo 成交在 2.375%-2.37%，午后震荡成交在 2.3925%-2.3825%，后回落 gvn 在 2.38%-2.3725%区间成交。盘中 6m repo trd 2.325%；4y repo 成交在 2.76%。曲线方面，1x4y repo spd 成交在 37.5bp；1x5y repo spd 成交在 47-47.25bp。

Shibor 方面，5y shibor 报收 25/24。1y shibor 成交在 2.6325%-2.645%。2y shibor 成交在 2.82%。曲线方面，6x9m shibor spd 成交在 2.75bp；6x1y shibor spd trd 11bp；1x2y shibor spd 成交在 18.75bp。Basis 方面，1y s/r basis 成交在 25.75，26.5bp；5y s/r basis 报收 41/40。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

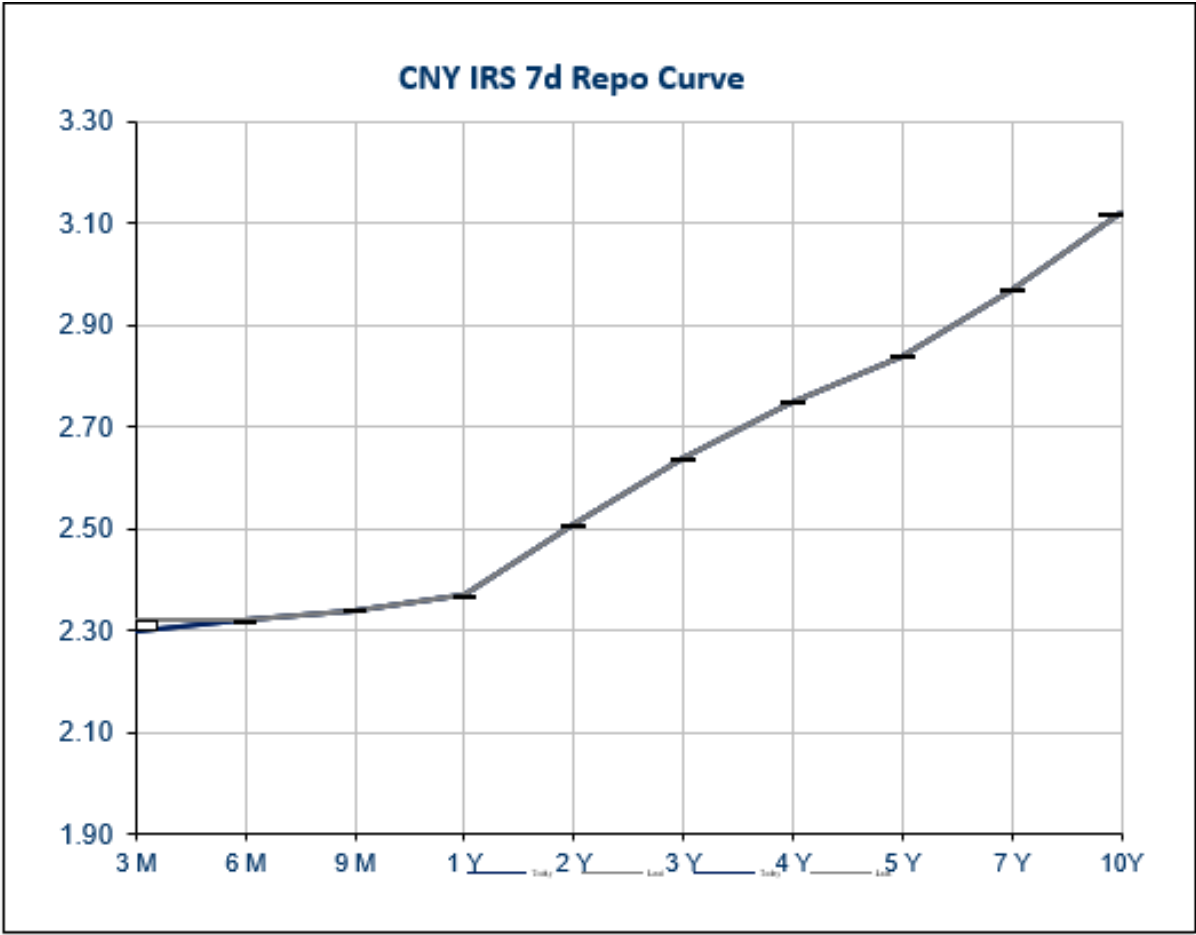
2023/3/24 Friday

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	2.3	-2				3 M	1.7	-									
6 M	2.32	-	6 M	2.53	1	6 M	1.9	-									
9 M	2.34	-	9 M	2.57	1	9 M	1.92	-									
1 Y	2.37	-	1 Y	2.64	1	1 Y	2.01	-				1Y	2.36	-1			
2 Y	2.51	-	2 Y	2.84	2	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.5	-			
3 Y	2.64	-	3 Y	3	2	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.63	-1			
4 Y	2.75	-	4 Y	3.13	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.74	1			
5 Y	2.84	-	5 Y	3.25	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.82	-			
7 Y	2.97	-	7 Y	3.39	1				7 Y	1.8	-						
10Y	3.12	-	10Y	3.52	1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.90	-30.00	3M Shibor	2.473	-0.30	0-N Shibor	1.288	-27.00	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
					Tenor	Mid	Δ bp
3M*6M	2	2					
6M*9M	2	-	4	-			
9M*1Y	3	-	7	-	6M	21	1
1*2Y	14	-	20	1	9M	23	1
1*3Y	27	-	36	1	1Y	27	1
1*4Y	38	-	49	-	2Y	33	2
1*5Y	47	-	61	-	3Y	36	2
2*3Y	13	-	16	-	4Y	38	1
2*4Y	24	-	29	-1	5Y	41	1
2*5Y	33	-	41	-1			
3*4Y	11	-	13	-1			
3*5Y	20	-	25	-1			
4*5Y	9	-	12	-			
5*7Y	13	-	14	-			
5*10Y	28	-	27	-			

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	4	-1	21
今日	-14	5	1	21



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:

以上所发及附加的所有信息 (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、时效性或准确性等要求。且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均受前述免责声明约束。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN