



【2023-02-13】

中国央行今日开展 460 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 1500 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1040 亿元。资金面方面整体均衡。7d repo fixing: 2.00%，与上一交易日减少 8bp。3m shibor fixing: 2.3710%，比上一交易日相比持平。

今日，5y repo 开盘成交在 2.865%，随着 omo 和期货开盘后，5y repo 下行震荡行成交在 2.8625%-2.8475%，午盘报收 85.25/84.75。午后回来，5y repo 随期货窄幅震荡成交在 2.8525%-2.86%，收盘 85/84.75。1y repo 成交在 2.275%-2.28%区间，报收 27.5/27.25。盘中，6m repo trd 2.16%；9m repo trd 2.22%-2.215%；2y repo 成交在 2.455%-2.46%；4y repo 成交在 2.7575%。曲线方面，6mx9m repo spd 成交在 5.5bp；6mx1y repo spd 成交在 11.75bp；9mx1y repo spd 成交在 6.25-6bp；1x2y repo spd trd 18bp；2x5y repo spd 成交在 39.75bp。4x5y repo spd 成交在 9.75bp，1x4y repo spd 成交在 47.75bp；1x5y repo spd 成交在 58.25-57.75bp，报收 57.75/57.25。

Shibor 方面，5y shibor 成交在 3.26%，报收 26.5/26。1y shibor 成交在 2.59%-2.58%，报收 58.5/58。曲线方面，1x2y shibor spd 成交在 21.25bp。Basis 方面，1y s/r basis 报收 31/30；2y s/r basis 成交在 33.5bp；3y s/r basis 成交在 35bp，4y s/r basis 成交在 37bp，5y s/r basis 成交在 41bp，报收 41.5/40.75。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

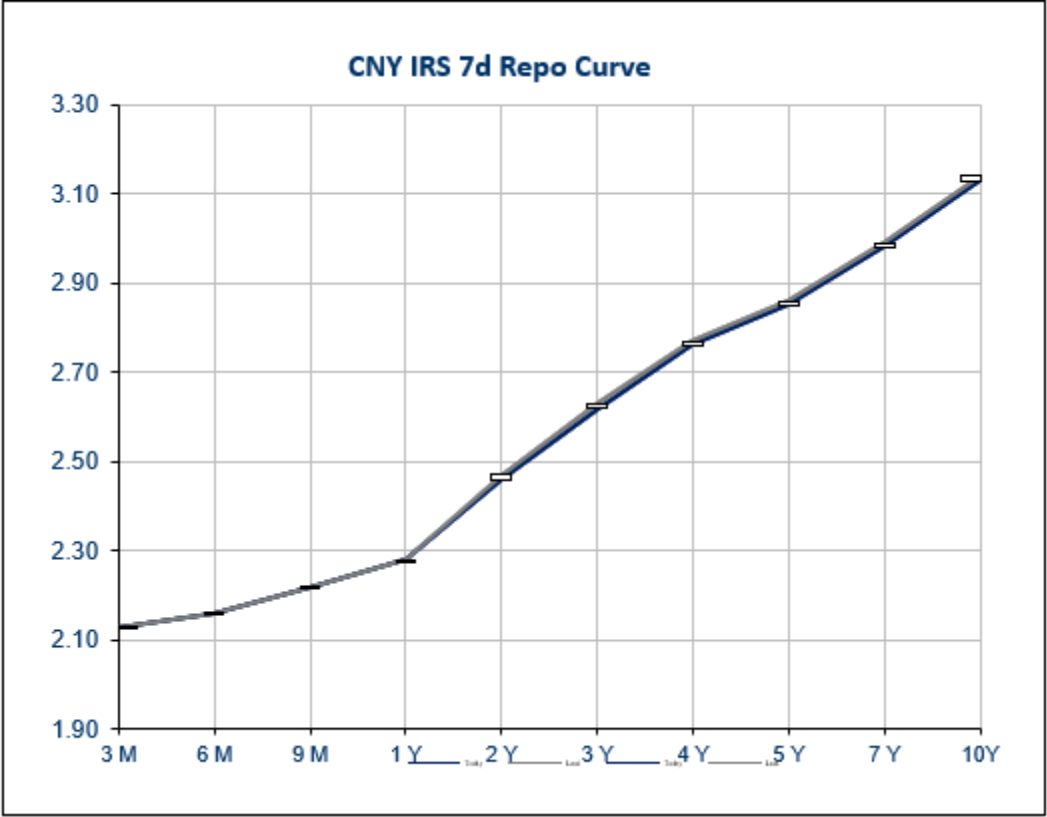
2023/2/13 Monday

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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.13	-				3 M	1.57	-						
6 M	2.16	-	6 M	2.45	-	6 M	1.75	-						
9 M	2.22	-	9 M	2.51	-1	9 M	1.82	-						
1 Y	2.28	-	1 Y	2.58	-1	1 Y	1.96	-				1Y	2.27	-
2 Y	2.46	-1	2 Y	2.79	-2	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.45	-1
3 Y	2.62	-1	3 Y	2.97	-2	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.61	-1
4 Y	2.76	-1	4 Y	3.13	-2				4 Y	1.8	-	4Y	2.73	-1
5 Y	2.85	-1	5 Y	3.26	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.83	-1
7 Y	2.98	-1	7 Y	3.42	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	3.13	-1	10Y	3.56	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	-8.00	3M Shibor	2.371	-	O-N Shibor	1.412	-45.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	3	-			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	6	-	6	-1			
9M*1Y	6	-	7	-	6M	29	-
1*2Y	18	-1	21	-1	9M	29	-1
1*3Y	34	-1	39	-1	1Y	30	-1
1*4Y	48	-1	55	-1	2Y	33	-1
1*5Y	57	-1	68	-	3Y	35	-1
2*3Y	16	-	18	-	4Y	37	-1
2*4Y	30	-	34	-	5Y	41	-
2*5Y	39	-	47	1			
3*4Y	14	-	16	-			
3*5Y	23	-	29	1			
4*5Y	9	-	13	1			
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	-19	5	-2	20
今日	-18	5	-2	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:

以上所查及列出的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的且/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国际证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际证券”) 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推介、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素, 且可能随时进行修订, 所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang