



【2023-03-06】

中国央行今日开展 7 天期 70 亿元逆回购操作，因今日有 3360 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 3290 亿元。资金面方面整体较松。7d repo fixing: 2.00%，与上一交易日相比不变。3m shibor fixing: 2.469%，比上一交易日增加 0.3bp。

Repo 端，今日，5y repo 开盘成交在 2.95%、2.955%，期货开盘后跳空高开且上行成交，5y repo 持续下行至 2.935%后震荡成交在 2.935%-2.94%，午盘报收 94/93.75。午后回来，5y repo 成交在 2.935%-2.9425%后震荡下行至 2.925%，报收 92.75/92.5。1y repo 随长端成交在 2.435%-2.4075%，报收 41.25/41。盘中 3m repo 成交在 2.31%；6m repo 成交在 2.345%-2.3425%；9m repo trd 2.48%；2y repo 成交在 2.585%-2.5875%。曲线方面，6mx9m spd trd 3.75bp，9mx1y spd trd 4bp，6mx1y spd trd 9bp； 1x5y repo spd 成交在 52-51.5bp，报收 51.75/51.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.7225%-2.72%，报收 71.5/71；2y shibor 成交在 2.935%，3y shibor 成交在 3.095%；4y shibor 成交在 3.24%； 5y shibor 成交在 3.3725%-3.36%，报收 35.755。Basis 方面，1y s/r basis 成交在 30bp，报收 30.25/30；5y s/r basis 成交在 42.25bp，报收 42.75/42

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/3/6 Monday

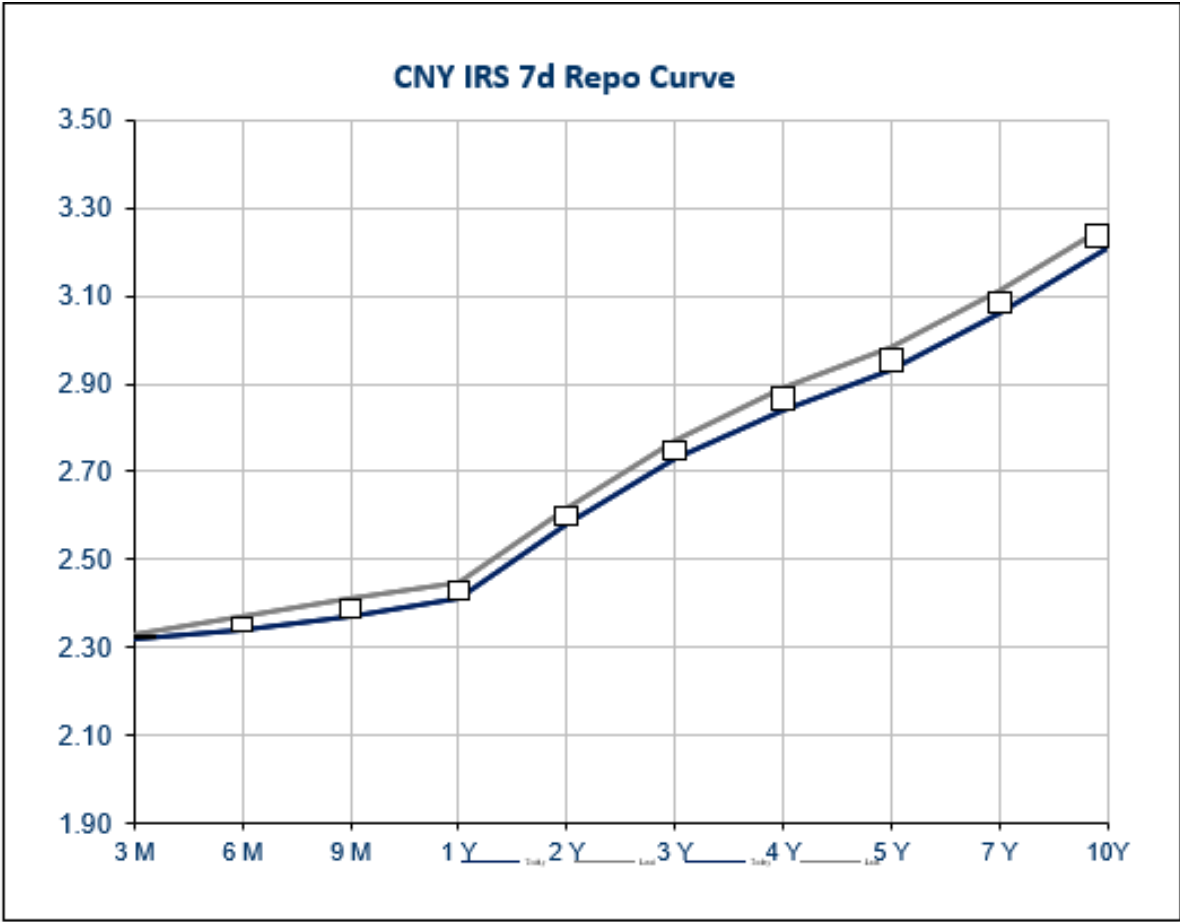
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.32	-1				3 M	1.62	-						
6 M	2.34	-3	6 M	2.56	-2	6 M	1.8	-						
9 M	2.37	-4	9 M	2.61	-3	9 M	1.87	-						
1 Y	2.41	-4	1 Y	2.71	-3	1 Y	2.01	-				1Y	2.42	-4
2 Y	2.58	-4	2 Y	2.94	-3	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.58	-5
3 Y	2.73	-4	3 Y	3.1	-3	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.73	-5
4 Y	2.84	-5	4 Y	3.23	-5				4 Y	1.8	-	4Y	2.83	-6
5 Y	2.93	-5	5 Y	3.36	-5				5 Y	1.8	-	5Y	2.92	-6
7 Y	3.06	-5	7 Y	3.52	-5				7 Y	1.8	-			
10Y	3.21	-5	10Y	3.66	-5				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	-	3M Shibor	2.469	0.30	O-N Shibor	1.231	-6.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	2	-2			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	3	-1	5	-1			
9M*1Y	4	-	10	-	6M	22	1
1*2Y	17	-	23	-	9M	24	1
1*3Y	32	-	39	-	1Y	30	1
1*4Y	43	-1	52	-2	2Y	36	1

1*5Y	52	-1	65	-2	3Y	37	1
2*3Y	15	-	16	-	4Y	39	-
2*4Y	26	-1	29	-2	5Y	43	-
2*5Y	35	-1	42	-2			
3*4Y	11	-1	13	-2			
3*5Y	20	-1	26	-2			
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	-28	-6	-5	12
今日	-26	-3	-4	14



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评及更多资讯



免责声明:
以上所含及附加的所有信息（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、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、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明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN