



【2023-03-13】

中国央行今日开展 7 天期 410 亿元逆回购操作，因今日有 70 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 340 亿元。资金面方面整体均衡。7d repo fixing: 2.2%，与上一交易日相比上行 10bp。3m shibor fixing: 2.498%，比上一交易日增加 0.1bp。

Repo 端，今日，5y repo 开盘成交在 2.86%-2.865%，期货开盘后，5y repo 随期货 tkn 至 2.89%，后震荡成交在 2.885%-2.8725%，午盘报收 88/87.75；午后，5y repo 开在 2.8775%，后下行震荡在 2.88%-2.865%之间，报收 86.5/86.25。1y repo 随长端震荡成交在 2.405%-2.4125%之间，报收 41/40.75。盘中 3m repo trd 2.335%；6m repo trd 2.355%；9m repo trd 2.3725%；2y repo 成交在 2.535%-2.5425%；3y repo 成交在 2.665%；4y repo 成交在 2.775%-2.78%。曲线方面，6x9m repo spd 成交在 1.75bp；9mx1y repo spd 成交在 3.5bp；1x2y repo spd 成交在 13.5bp；1x5y repo spd 成交在 47.5-46.5bp，报收 45.75/45.25。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.695%，报收 69.75/69.25；2y shibor 成交在 2.895%；3y shibor 成交在 3.045%；4y shibor 成交在 3.1725%；5y shibor 成交在 3.285%-3.2925%，报收 28.25/27.75。曲线方面，1x2y shibor spd trd 20bp；2x5 shibor spd trd 39.75bp。Basis 方面，1y s/r basis trd 28.5bp，报收 29/28.5；5y s/r basis 成交在 41.75bp，报收 41.75/41.25。Box 方面，1x5 shibor/repo basis 成交在 13.25bp。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

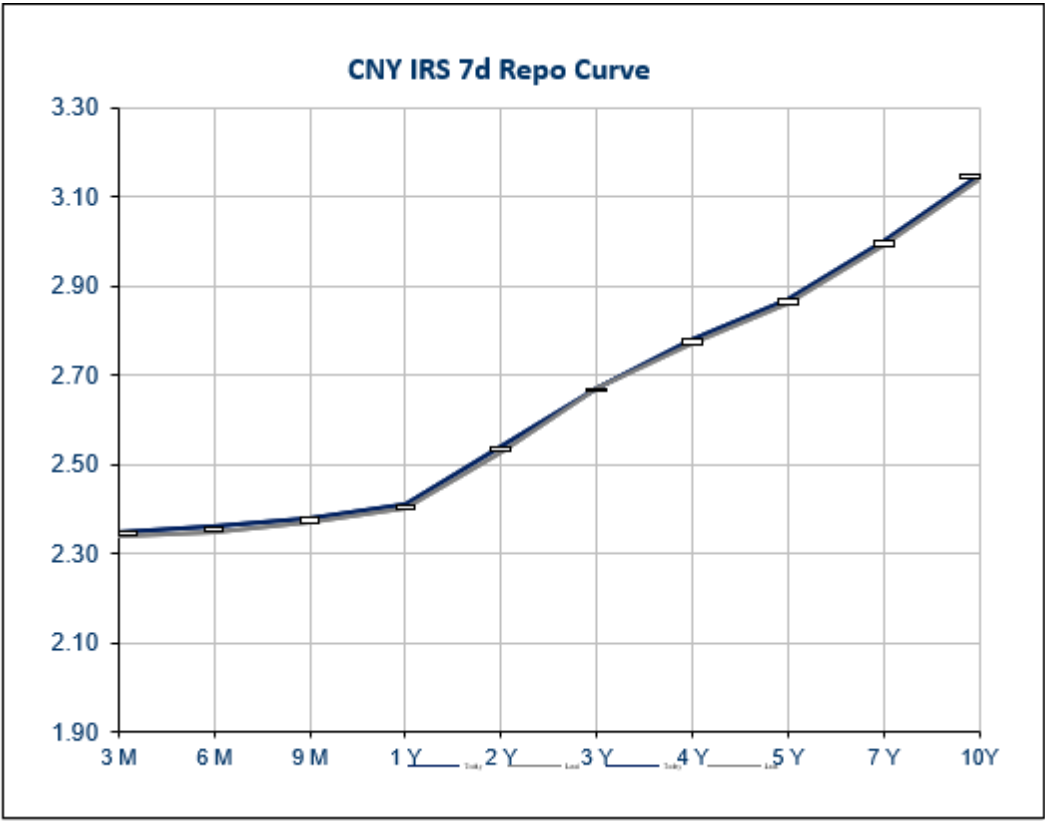
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2023/3/13 Monday

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	2.35	1				3 M	1.65	-						
6 M	2.36	1	6 M	2.57	-	6 M	1.85	-						
9 M	2.38	1	9 M	2.61	-	9 M	1.92	-						
1 Y	2.41	1	1 Y	2.69	1	1 Y	2.01	-				1Y	2.4	-
2 Y	2.54	1	2 Y	2.89	-	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.54	-
3 Y	2.67	-	3 Y	3.04	1	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.67	1
4 Y	2.78	1	4 Y	3.17	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.77	1
5 Y	2.87	1	5 Y	3.29	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.86	1
7 Y	3	1	7 Y	3.43	2				7 Y	1.8	-			
10Y	3.15	1	10Y	3.56	2				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.20	10.00	3M Shibor	2.498	0.10	O-N Shibor	1.614	-21.50	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	1	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	2	-	4	-				
9M*1Y	3	-	8	1	6M	21	-1	
1*2Y	13	-	20	-1	9M	23	-1	
1*3Y	26	-1	35	-	1Y	28	-	
1*4Y	37	-	48	-	2Y	35	-1	
1*5Y	46	-	60	1	3Y	37	1	
2*3Y	13	-1	15	1	4Y	39	-	
2*4Y	24	-	28	1	5Y	42	1	
2*5Y	33	-	40	2				
3*4Y	11	1	13	-				
3*5Y	20	1	25	1				
4*5Y	9	-	12	1				
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	-18	1	0	19
今日	-18	1	0	19



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:

以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的、/或者专用的信息。其知识产仅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”) 或其三方。“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、时效性或准确性等要素。后续未经通知将进行修改。所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang