



【2023-02-16】

中国央行今日开展 4870 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 4530 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 340 亿元。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 2.13%，与上一交易日上涨 3bp，3m shibor fixing: 2.3830%，与上一交易日上升 0.4bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.8625%附近，后稍微震荡上行，最低成交在 2.86%，最高成交至 2.875%，在 2.8675%位置成交较多，午盘报收 87.25/87。午后，5y repo 成交 2.8725%，后因消息面影响期货快速拉升，5y repo 最低下行至 2.8475%，成交区间后维稳在 2.85%-2.8625%区间附近，报收 86.5/86.25。1y repo 开盘成交在 2.31%，后震荡上行最高成交至 2.3225%，成交区间在 2.31% - 2.3225%，午盘报收 31.75/31.5。午后因消息面震荡，最低成交至 2.30%，后维稳在 2.315% - 2.32%，报收 32/31.75。其他期限，2y repo 成交在 2.4775%-2.49%区间附近，3y repo 成交在 2.6275% - 2.6475%。曲线方面，1x2y repo 成交在 16.5bp；1x3y repo 成交在 32.5bp；3x5y repo 成交在 22.25bp-22.5bp；1x5y repo 成交在 54.5bp-55.5bp 区间，报收 54.75/54.25。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.62%，报收 63.25/62.75；2y shibor 成交 2.83%-2.835%；3y shibor 成交在 3.00%；4y shibor 成交在 3.14%-3.1475%；5y shibor 成交 3.2825%，报收 28.25/27.75。基差方面，1y basis 成交在 30bp，报收 31.25/30.75，4y basis 成交在 37.25bp，5y basis 成交在 41.75bp，报收 41.75/41.5。曲线方面，1x2y shibor spd 成交在 21bp，4x5y shibor spd 成交在 14bp，1x5y shibor spd 报收 65.5/64.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

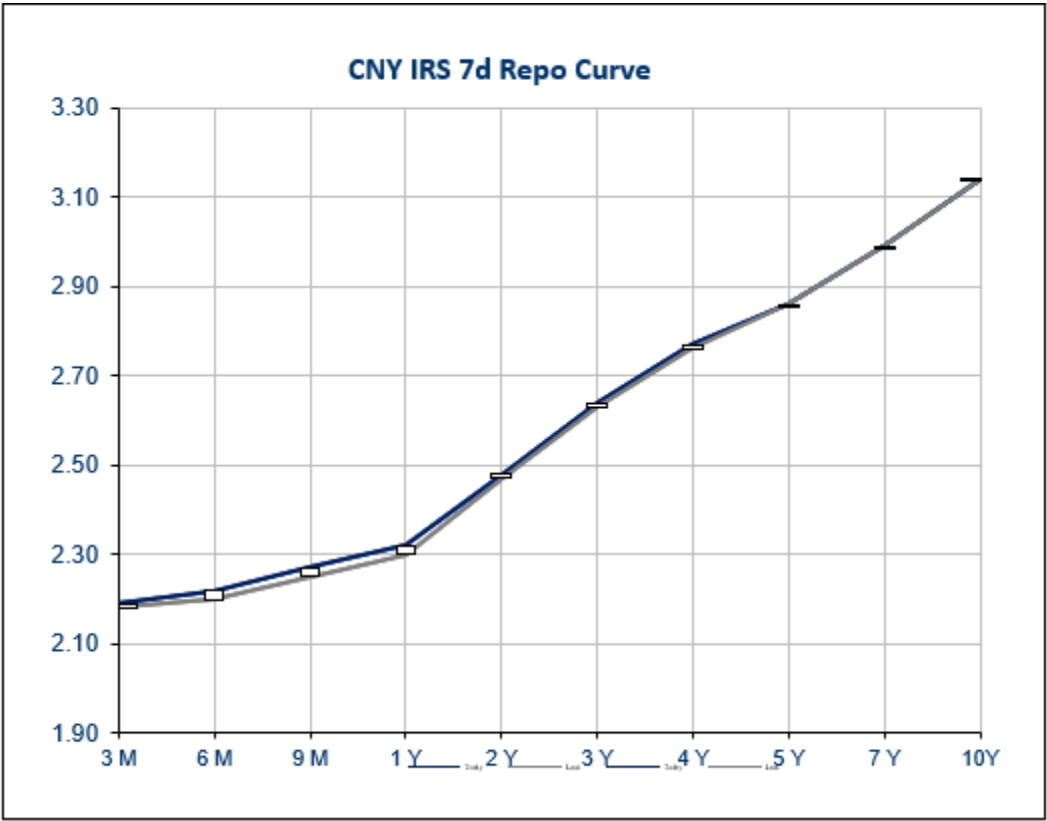
2023/2/16 Thursday

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	2.19	1				3 M	1.57	-						
6 M	2.22	2	6 M	2.48	1	6 M	1.75	-						
9 M	2.27	2	9 M	2.56	2	9 M	1.82	-						
1 Y	2.32	2	1 Y	2.63	3	1 Y	1.96	-				1Y	2.31	1
2 Y	2.48	1	2 Y	2.83	2	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.48	1
3 Y	2.64	1	3 Y	3	1	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.63	1
4 Y	2.77	1	4 Y	3.15	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.76	1
5 Y	2.86	-	5 Y	3.28	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.85	1
7 Y	2.99	-	7 Y	3.44	1				7 Y	1.8	-			
10Y	3.14	-	10Y	3.58	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.13	3.00	3M Shibor	2.383	0.40	O-N Shibor	2.005	10.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	3	1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	5	-	8	1			
9M*1Y	5	-	7	1	6M	26	-1
1*2Y	16	-1	20	-1	9M	29	-
1*3Y	32	-1	37	-2	1Y	31	1
1*4Y	45	-1	52	-2	2Y	35	1
1*5Y	54	-2	65	-2	3Y	36	-
2*3Y	16	-	17	-1	4Y	38	-
2*4Y	29	-	32	-1	5Y	42	1
2*5Y	38	-1	45	-1			
3*4Y	13	-	15	-			
3*5Y	22	-1	28	-			
4*5Y	9	-1	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	-19	4	-2	19
今日	-20	4	-3	19



联系人: Ruby Wu

邮箱: rubywu@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:

以上所登及附登的所有信息 (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求, 且可未经通知而进行修改, 所有前述和保证均经特此免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang