



【2023-02-17】

中国央行今日开展 8350 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 2030 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 6320 亿元。资金面方面整体均衡。7d repo fixing: 2.50%，与上一交易日增加 37bp。3m shibor fixing: 2.3850%，比上一交易日增加 0.2bp。

今日，5y repo 开盘成交在 2.8675%-2.865%，后期货下行，5y repo tkn 在 2.87%-2.8725%区间成交。午后回来，5y repo 下行成交在 2.8675%-2.86%。1y repo 震蕩成交在 2.3175%-2.325%，后下行成交在 2.315%-2.31%。盘中 2y repo trd 2.49%-2.4875%。曲线方面，1mx3m repo trd -3bp；6x9m repo spd 成交在 4.5bp；9mx1y repo spd 成交在 5-4.75bp；1x5y repo spd 成交在 54.75-55.25bp；2x5y repo spd trd 38-38.25bp。

Shibor 今日成交清淡，1y shibor 成交在 2.6325%-2.63%。5y shibor 报收 27.5/27。Basis 方面，1y s/r basis 成交在 30.75-31bp；5y s/r basis 报收 41.5/41。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

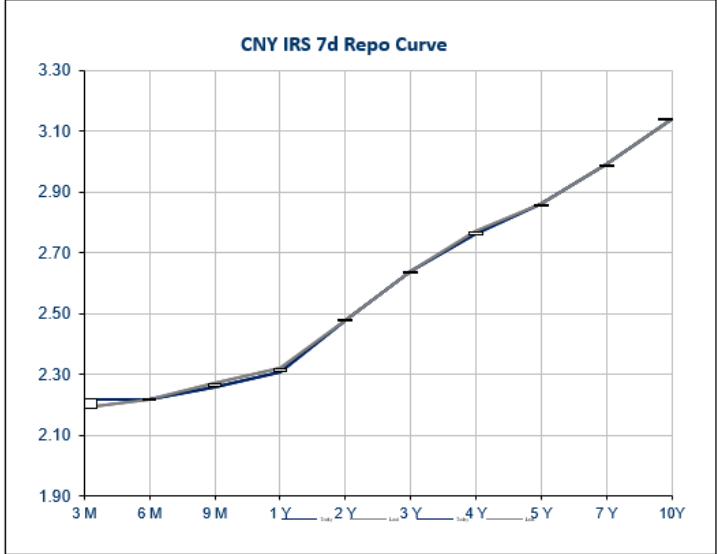
2023/2/17 Friday

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	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp			
3 M	2.22	3				3 M	1.57	-									
6 M	2.22	-	6 M	2.49	1	6 M	1.75	-									
9 M	2.26	-1	9 M	2.55	-1	9 M	1.82	-									
1 Y	2.31	-1	1 Y	2.62	-1	1 Y	1.96	-				1Y	2.32	1			
2 Y	2.48	-	2 Y	2.83	-	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.48	-			
3 Y	2.64	-	3 Y	3	-	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.64	1			
4 Y	2.76	-1	4 Y	3.14	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.76	-			
5 Y	2.86	-	5 Y	3.27	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.85	-			
7 Y	2.99	-	7 Y	3.43	-1				7 Y	1.8	-						
10Y	3.14	-	10Y	3.57	-1				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.50	37.00	3M Shibor	2.385	0.20	O-N Shibor	2.115	11.00	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0 -3		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	4 -1	6 -2				
9M*1Y	5 -	7 -	6M	27	1	
1*2Y	17 1	21 1	9M	29	-	
1*3Y	33 1	38 1	1Y	31	-	
1*4Y	45 -	52 -	2Y	35	-	
1*5Y	55 1	65 -	3Y	36	-	
2*3Y	16 -	17 -	4Y	38	-	
2*4Y	28 -1	31 -1	5Y	41	-1	
2*5Y	38 -	44 -1				
3*4Y	12 -1	14 -1				
3*5Y	22 -	27 -1				
4*5Y	10 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	220022/5y	220019/5y	220203/5y	220220/5y
Swap	repo	repo	repo	repo
昨日	-20	4	-3	19
今日	-19	4	-2	20



联系人: Ruby Yu
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:

以上所登及列加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的利/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、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明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN