



【2023-02-03】

今日，中国央行今日开展 230 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 3190 亿元 14 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2960 亿元。资金面方面整体均衡。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日减少 15bp。3m shibor fixing: 2.3570%，比上一交易日减少 0.3bp。数据方面，中国 1 月财新服务业 PMI 前值 48 预期 51 公布 52.9。

今日，5y repo 开盘成交在 2.85%-2.845%，后上行震荡成交在 2.855%-2.8675%。午前收盘 tkn 在 2.87%位置。午后回来，5y repo 下行成交在 2.8625%-2.855%。1y repo 全天成交在 2.245%-2.255%区间。盘中 2y repo trd 2.4475%-2.46%；4y repo 成交在 2.76%。曲线方面，3mx6m repo spd 成交在 6bp；6x9m repo spd trd 6.75bp；1x2y repo spd 成交在 20.5bp；1x5y repo spd 成交在 59.75-60bp，午后上行成交在 61-61.25bp；2x5y repo spd trd 40.5bp。

Shibor 方面，5y shibor 成交在 3.245%-3.2625%。1y shibor 成交在 2.58%。曲线方面，1x5y shibor spd 成交在 67.5bp。Basis 方面，1y s/r basis 成交在 33bp；5y s/r basis 成交在 39.75-40bp。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2023/2/3 Friday

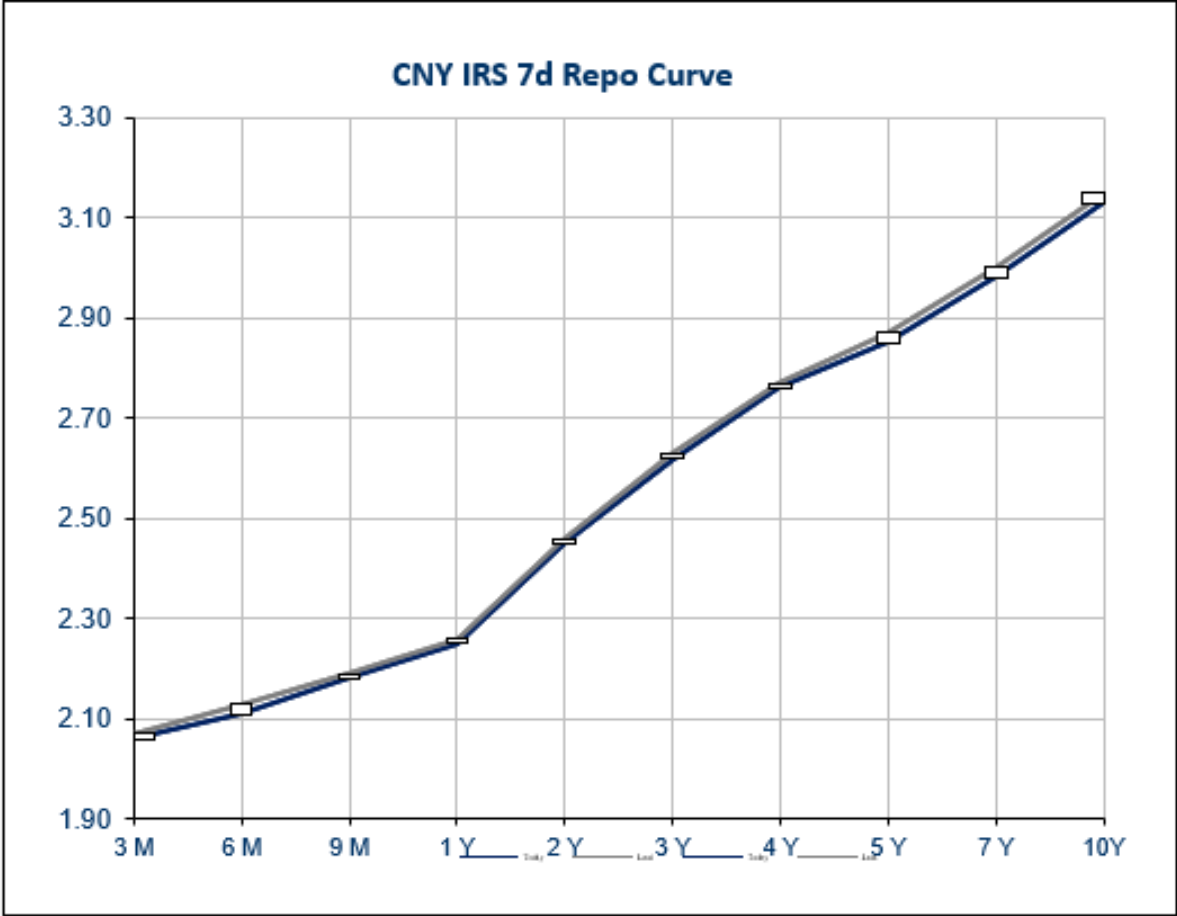
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.06	-1				3 M	1.57	-						
6 M	2.11	-2	6 M	2.45	-	6 M	1.75	-						
9 M	2.18	-1	9 M	2.51	-	9 M	1.82	-						
1 Y	2.25	-1	1 Y	2.58	-	1 Y	1.96	-				1Y	2.25	-
2 Y	2.45	-1	2 Y	2.78	-	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.45	-
3 Y	2.62	-1	3 Y	2.95	-	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.62	-1
4 Y	2.76	-1	4 Y	3.12	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.74	-1
5 Y	2.85	-2	5 Y	3.25	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.84	-
7 Y	2.98	-2	7 Y	3.41	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	3.13	-2	10Y	3.57	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-15.00	3M Shibor	2.357	-0.30	O-N Shibor	1.262	-37.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	5	-1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	7	1	6	-			
9M*1Y	7	-	7	-	6M	34	2
1*2Y	20	-	20	-	9M	33	1
1*3Y	37	-	37	-	1Y	33	1
1*4Y	51	-	54	-	2Y	33	1

1*5Y	60	-1	67	-1	3Y	33	1
2*3Y	17	-	17	-	4Y	36	1
2*4Y	31	-	34	-	5Y	40	1
2*5Y	40	-1	47	-1			
3*4Y	14	-	17	-			
3*5Y	23	-1	30	-1			
4*5Y	9	-1	13	-1			
5*7Y	13	-	16	-			
5*10Y	28	-	32	-			

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	6	-1	19
今日	-18	6	-1	20



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:
以上所登及附加的所有信息 (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