



【2023-02-06】

今日，中国央行今日开展 1500 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 5230 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 3730 亿元。资金面方面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 2.03%，与上一交易日增加 13bp。3m shibor fixing: 2.3590%，比上一交易日增加 0.2bp。

今日，5y repo 开盘成交在 2.84%-2.85%，期货开盘下行，5y repo tkn 至 2.87%后，下行震荡成交在 2.865%-2.86%，午盘报收 86.7/86.5。午后回来，5y repo 上行成交在 2.8675%-2.875%，后震荡成交在 2.8725%-2.865%，尾盘期货下行，5y repo tkn 至 2.8875%后震荡成交在 2.88%-2.89%，报收 89/88.5。1y repo 全天随长端成交在 2.245%-2.29%区间，报收 29/28.5。盘中，2y repo trd 2.465%-2.48%；3y repo 成交在 2.6325%-2.645%。曲线方面，1x2y repo spd 成交在 20bp; 2x5y repo spd trd 40bp; 3x5 repo spd 成交在 23bp; 1x5y repo spd 成交在 60.25-59.75bp，报收 60.25/60。

Shibor 方面，1y shibor 成交在 2.59-2.6075%，报收 62.5/61.5, 5y shibor 报收 30/29。曲线方面，9mx1y shibor spd 成交在 7.75bp，6mx9m shibor spd 成交在 7bp。Basis 方面，1y s/r basis 成交在 33bp，报收 33.5/33; 2y s/r basis 成交在 33bp, 5y s/r basis 报收 41/40.25。Box 方面，1x2 shibor box 成交在 00bp。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/2/6 Monday

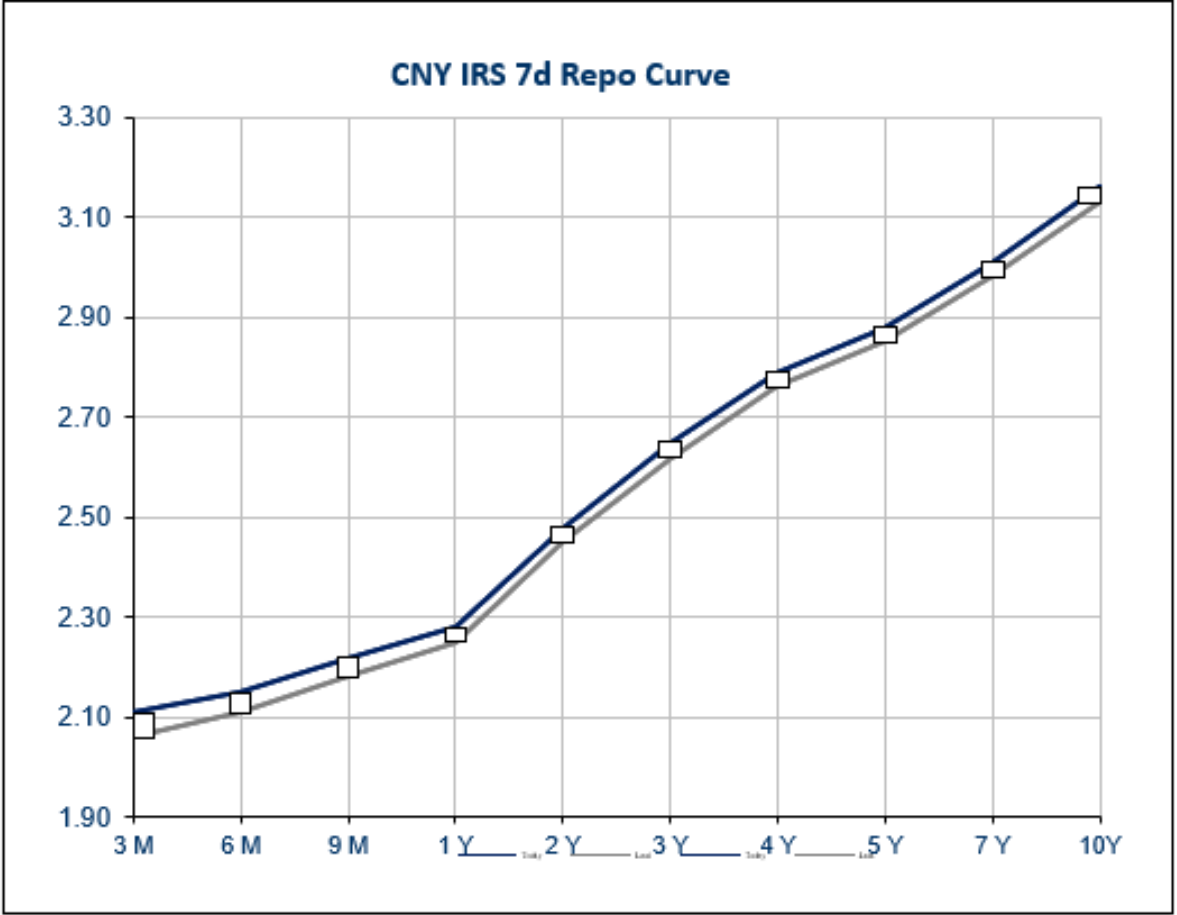
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.11	5				3 M	1.57	-						
6 M	2.15	4	6 M	2.46	1	6 M	1.75	-						
9 M	2.22	4	9 M	2.54	3	9 M	1.82	-						
1 Y	2.28	3	1 Y	2.61	3	1 Y	1.96	-				1Y	2.29	4
2 Y	2.48	3	2 Y	2.83	5	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.49	4
3 Y	2.65	3	3 Y	3	5	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.66	4
4 Y	2.79	3	4 Y	3.15	3				4 Y	1.8	-	4Y	2.79	5
5 Y	2.88	3	5 Y	3.29	4				5 Y	1.8	-	5Y	2.88	4
7 Y	3.01	3	7 Y	3.45	4				7 Y	1.8	-			
10Y	3.16	3	10Y	3.59	2				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.03	13.00	3M Shibor	2.359	0.20	O-N Shibor	1.782	52.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	4	-1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	7	-	8	2			
9M*1Y	6	-1	7	-	6M	31	-3
1*2Y	20	-	22	2	9M	32	-1
1*3Y	37	-	39	2	1Y	33	-
1*4Y	51	-	54	-	2Y	35	2
1*5Y	60	-	68	1	3Y	35	2
2*3Y	17	-	17	-	4Y	36	-
2*4Y	31	-	32	-2	5Y	41	1

2*5Y	40	-	46	-1		
3*4Y	14	-	15	-2		
3*5Y	23	-	29	-1		
4*5Y	9	-	14	1		
5*7Y	13	-	16	-		
5*10Y	28	-	30	-2		

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	-18	6	-1	20
今日	-20	4	-3	18



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