



【2023-03-08】

中国央行今日进行 40 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 2.00%，与此前持平。今日有 1070 亿元逆回购到期。资金面整体宽松。7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 2.4860%，与上一交易日上升 1bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.9075%附近，后震荡成交在 2.91%-2.9225%区间附近，午盘报收 92/91.75。中午回来，5y repo 成交在 2.92%附近，后震荡上行，成交在 2.9225%-2.9375%区间附近，报收 93.5/93。1y repo 全天随长端震荡成交在 2.42%-2.435%区间附近，报收 43.25/42.75。其他期限，6m repo 成交在 2.365%附近，9m repo 成交在 2.395%附近，2y repo 成交在 2.565%-2.585%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 03bp 附近，9mx1y repo 成交在 04bp 附近，6mx1y repo 成交在 07bp 附近，1x5y repo 成交在 49.75-50.25bp 附近，报收 50.5/50。

Shibor 端，9m shibor 成交在 2.6225%附近，1y shibor 成交在 2.725%区间附近，报收 73.25/72.5，2y shibor 成交在 2.935%附近，4y shibor 成交在 3.215%-3.2225%区间附近，5y shibor 成交在 3.3425%-3.35%附近，报收 35.5/35。曲线方面，9mx1y shibor 成交在 10.25bp 附近，4x5y shibor 成交在 12.75-12.5bp 附近，基差方面，1y basis 成交在 29.5bp 附近，报收 29.75/29.5，2y basis 成交在 35bp 附近，5y basis 成交在 41.75bp 附近，报收 42.5/42。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/3/8 Wednesday

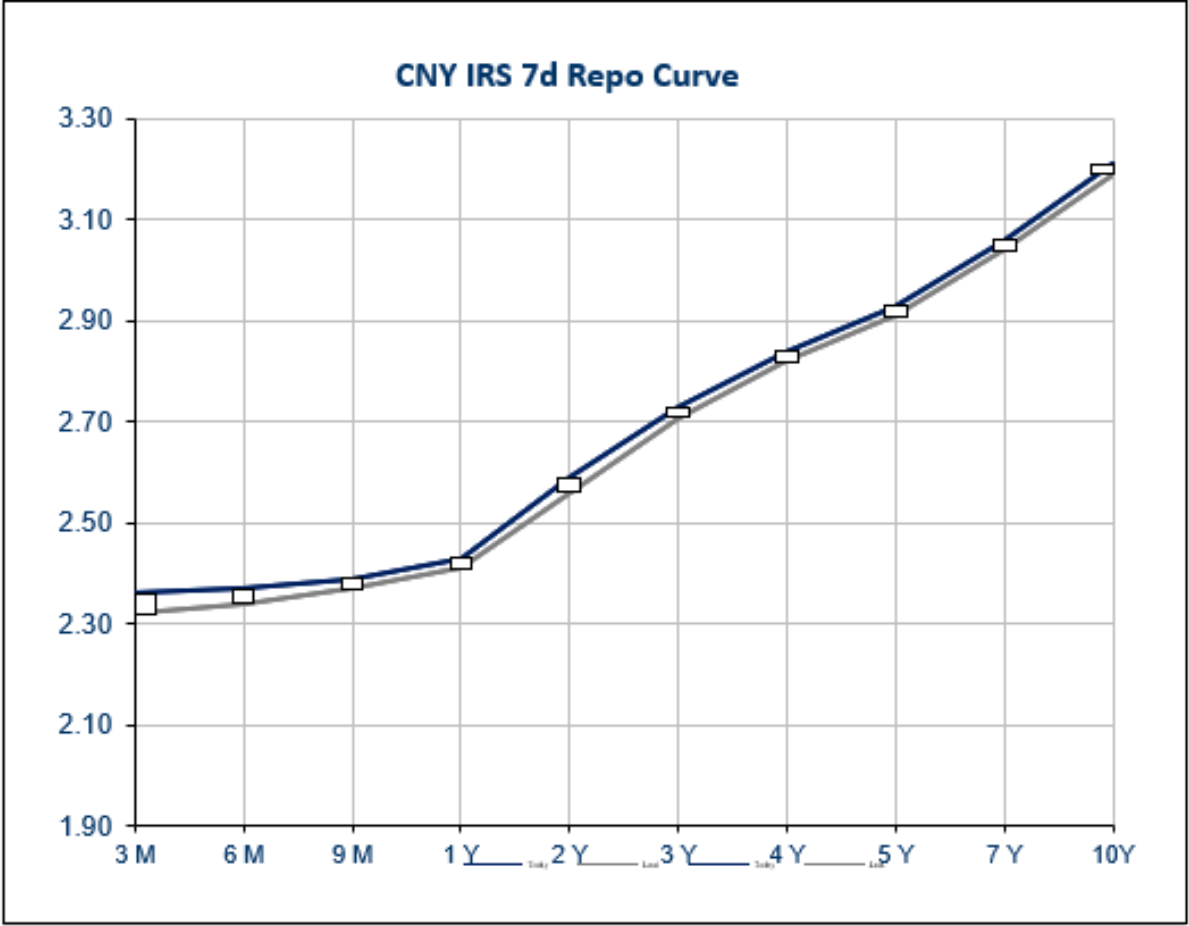
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.36	4				3 M	1.65	3						
6 M	2.37	3	6 M	2.58	2	6 M	1.85	5						
9 M	2.39	2	9 M	2.63	2	9 M	1.92	5						
1 Y	2.43	2	1 Y	2.73	2	1 Y	2.01	-				1Y	2.44	3
2 Y	2.59	3	2 Y	2.94	2	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.6	3
3 Y	2.73	2	3 Y	3.09	1	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.74	2
4 Y	2.84	2	4 Y	3.23	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.85	3
5 Y	2.93	2	5 Y	3.35	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.94	3
7 Y	3.06	2	7 Y	3.49	-				7 Y	1.8	-			
10Y	3.21	2	10Y	3.62	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	-	3M Shibor	2.486	1.00	O-N Shibor	1.648	21.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	1	-1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	2	-1	5	-			
9M*1Y	4	-	10	-	6M	21	-1

1*2Y	16	1	21	-	9M	24	-
1*3Y	30	-	36	-1	1Y	30	-
1*4Y	41	-	50	-1	2Y	35	-1
1*5Y	50	-	62	-1	3Y	36	-1
2*3Y	14	-1	15	-1	4Y	39	-1
2*4Y	25	-1	29	-1	5Y	42	-1
2*5Y	34	-1	41	-1			
3*4Y	11	-	14	-			
3*5Y	20	-	26	-			
4*5Y	9	-	12	-			
5*7Y	13	-	14	-1			
5*10Y	28	-	27	-1			

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	-23	-3	-4	14
今日	-23	-4	-4	14



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