



【2023-02-15】

中国央行今日进行 4990 亿元一年期 MLF 操作，利率持稳于 2.75%。今日有 3000 亿元 MLF 到期。此外，中国央行今日进行 2030 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 6410 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 2.10%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 2.3790%，与上一交易日上升 0.6bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.86%附近，后稍微震荡上行，成交在 2.8625%-2.87%区间附近，午盘报收 86.75/86.25。中午回来，5y repo 小幅震荡下行，成交在 2.865%-2.855%区间附近，报收 85.75/85.55。1y repo 全天随长端震荡成交在 2.315%-2.30%区间附近，报收 30.25/30。其他期限， 9m repo 成交在 2.25%-2.2525%区间附近，2y repo 成交在 2.4825%附近。曲线方面，1x5y repo 成交在 55.25bp 附近，报收 55.75/55.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 成交在 2.615%-2.6075%区间附近，报收 60.5/60，5y shibor 报收 27.5/26.5。基差方面，1y basis 成交在 30-30.25bp 附近，报收 30.5/30.25，5y basis 报收 41.75/41。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

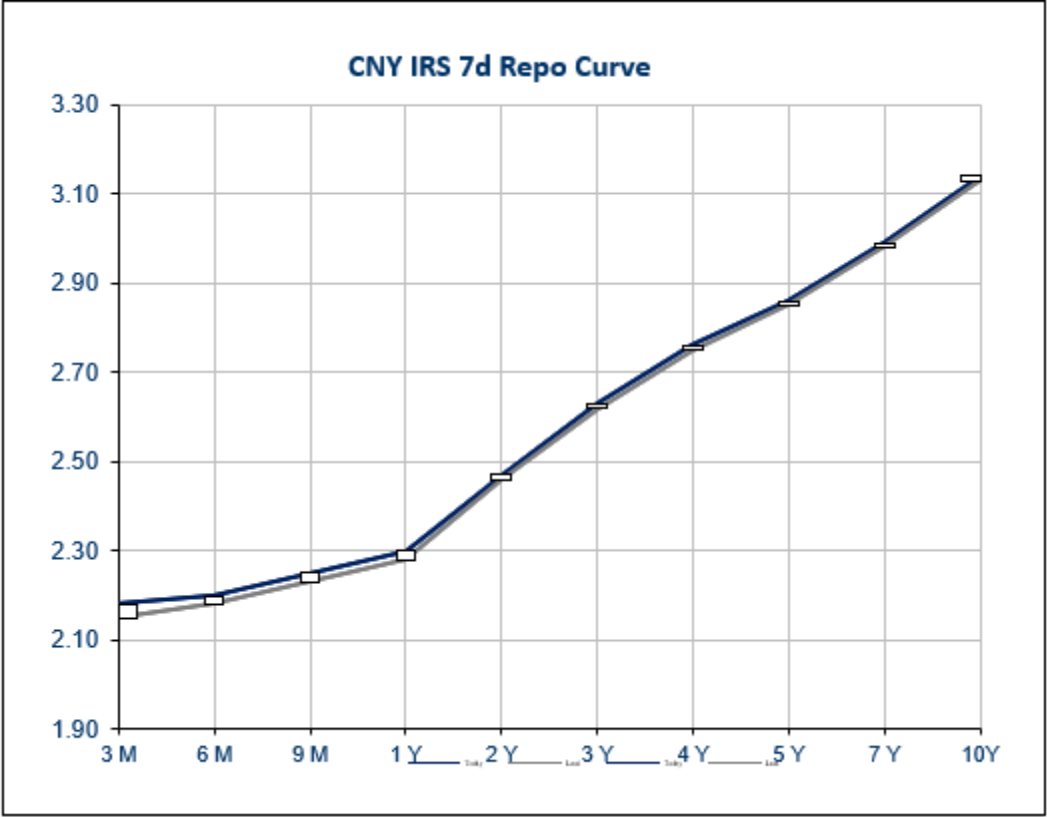
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2023/2/15 Wednesday

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	2.18	3				3 M	1.57	-						
6 M	2.2	2	6 M	2.47	1	6 M	1.75	-						
9 M	2.25	2	9 M	2.54	2	9 M	1.82	-						
1 Y	2.3	2	1 Y	2.6	2	1 Y	1.96	-				1Y	2.3	2
2 Y	2.47	1	2 Y	2.81	1	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.47	2
3 Y	2.63	1	3 Y	2.99	2	3 Y	2.05	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.62	1
4 Y	2.76	1	4 Y	3.14	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.75	2
5 Y	2.86	1	5 Y	3.27	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.84	1
7 Y	2.99	1	7 Y	3.43	1				7 Y	1.8	-			
10Y	3.14	1	10Y	3.57	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.10	-3.00	3M Shibor	2.379	0.60	O-N Shibor	1.902	32.60	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	2	-1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	5	-	7	1				
9M*1Y	5	-	6	-	6M	27	-1	
1*2Y	17	-1	21	-1	9M	29	-	
1*3Y	33	-1	39	-	1Y	30	-	
1*4Y	46	-1	54	-1	2Y	34	-	
1*5Y	56	-1	67	-1	3Y	36	1	
2*3Y	16	-	18	1	4Y	38	-	
2*4Y	29	-	33	-	5Y	41	-	
2*5Y	39	-	46	-				
3*4Y	13	-	15	-1				
3*5Y	23	-	28	-1				
4*5Y	10	-	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	-18	6	-2	20
今日	-19	4	-2	19



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报及更多资讯



免责声明:
以上所登及附送的所有信息 (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、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