



【2022-11-21】

中国央行今日开展 7 天期 30 亿元逆回购操作，因今日有 50 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 20 亿元，资金面均衡偏松。7d repo fixing:1.7%，与上一交易日相比降低 11bp；3m shibor fixing: 2.2410%，比上一交易日增加 0.3bp。

数据方面，中国至 11 月 21 日五年期贷款市场报价利率 4.3%，预期 4.30%，前值 4.30%。中国至 11 月 21 日一年期贷款市场报价利率 3.65%，预期 3.65%，前值 3.65%。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.745%，后一路 gvn 至 2.73%，期货开盘后，5y repo 震荡成交在 2.7375%-2.725%附近，午盘报收 73/72.75；午后国债期货震荡下行，5y repo 随期货上行成交在 2.7275%-2.765%，临近尾盘稍微下行，报收 76.25/76。盘中，1y repo 全天随长端震荡成交在 2.20%-2.245%，报收 24/23。3y repo 成交在 2.555%附近，曲线方面，1x5y repo 成交在 52.5-53bp 附近，报收 52.75/52.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.385%-2.435%，报收 44.75/44.25，5y shibor 成交在 3.0825%-3.1225 报收 13/12。曲线方面，1x5y shibor 成交在 69bp-68bp 附近，报收 70.75/69.5。基差方面，1y basis 成交在 19.25bp-21bp 附近，报收 21.5/21，5y basis 成交在 35.75bp-36.5bp 附近，报收 37/36。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

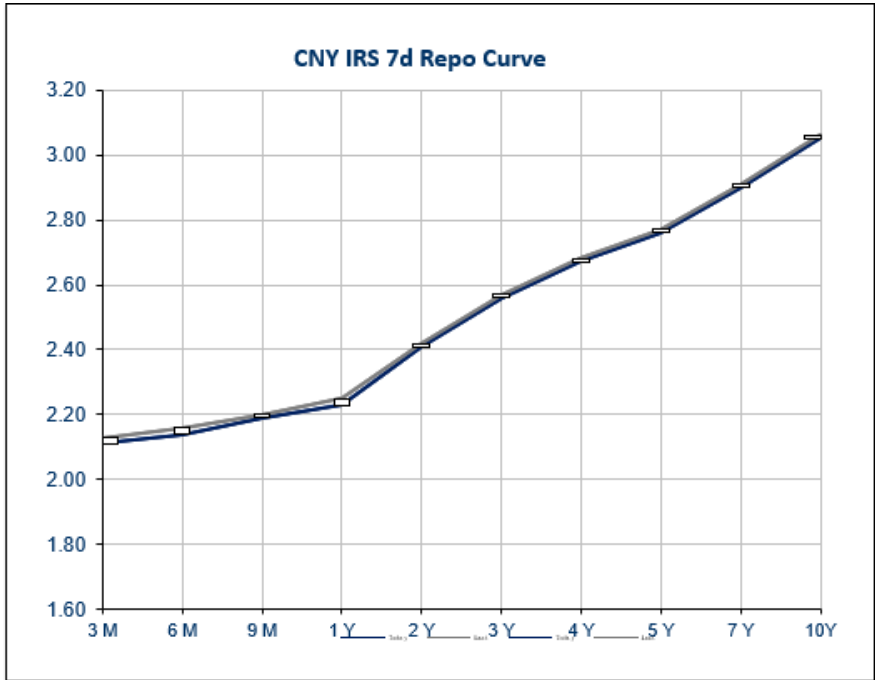
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2022/11/21 Monday

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	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp			
3 M	2.11	-2				3 M	1.71	-									
6 M	2.14	-2	6 M	2.31	-	6 M	1.78	-									
9 M	2.19	-1	9 M	2.38	2	9 M	1.84	-									
1 Y	2.23	-2	1 Y	2.44	-	1 Y	1.92	-				1Y	2.23	-2			
2 Y	2.41	-1	2 Y	2.66	-1	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.41	-2			
3 Y	2.56	-1	3 Y	2.82	-1	3 Y	2.03	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.55	-2			
4 Y	2.67	-1	4 Y	2.98	-2				4 Y	1.8	-	4Y	2.67	-2			
5 Y	2.76	-1	5 Y	3.12	-2				5 Y	1.8	-	5Y	2.76	-2			
7 Y	2.9	-1	7 Y	3.32	-2				7 Y	1.8	-						
10Y	3.05	-1	10Y	3.47	-2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.70	-11.00	3M Shibor	2.241	0.30	O-N Shibor	1.139	-22.50	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	3 -		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	5 1	7 2				
9M*1Y	4 -1	6 -2	6M	17	2	
1*2Y	18 1	22 -1	9M	19	3	
1*3Y	33 1	38 -1	1Y	21	2	
1*4Y	44 1	54 -2	2Y	25	-	
1*5Y	53 1	68 -2	3Y	26	-	
2*3Y	15 -	16 -	4Y	31	-1	
2*4Y	26 -	32 -1	5Y	36	-1	
2*5Y	35 -	46 -1				
3*4Y	11 -	16 -1				
3*5Y	20 -	30 -1				
4*5Y	9 -	14 -				
5*7Y	14 -	20 -				
5*10Y	29 -	35 -				

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	220016/5y repo	220010/5y repo	220208/5y repo	220215/5y repo
昨日	-14	10	-3	21
今日	-14	12	-3	21



联系人: Ruby Su
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:

以上所述及附带的信息 (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”不能也不应被复制为与任何金融工具、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、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