



【2022-11-10】

中国央行今日进行 90 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 2.00%，与此前持平。今日 7d 逆回购到期 70 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing:1.90%，比上一交易日减少 1bp；3m shibor fixing: 1.8380%，比上一交易日增加 3.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.55%，随后逐步 gvn 至 2.5425%，2.54%等位置，临近午盘稍有上行，报收 55/54.5；午后国债期货震荡下行，利率上行成交在 2.55%-2.57%，临近尾盘报收 57/56.75。1y repo 全天空头强势，上行成交在 2.0475%-2.09%，报收 9/8.75。3m repo 成交在 1.965%，6m repo 成交在 1.9875%，9m repo 成交在 2.035%，2y repo 成交 2.1875%-2.215%，3y repo 成交在 2.335%，4y repo 成交在 2.455%。曲线方面多有走平，3mx6m repo 成交在 2.25bp 附近，6mx1y repo 成交在 7.5bp 附近，9mx1y repo 成交在 04bp，1x2y repo 成交 13.5bp 附近，4x5y repo 成交在 10bp 附近，2x5y repo 成交在 35bp 附近，1x5y repo 成交在 49-49.5bp 附近，报收 48/47.75。

Shibor 端明显上行，1y shibor 成交在 2.1525%-2.205%附近，报收 22.5/21.5，5y shibor 成交在 2.9125%，报收 94.5/93.5。基差方面明显走阔，1y basis 成交在 11-12.75bp 附近，报收 13.25/12.75，5y basis 成交在 36.5bp 附近，报收 37.5/37。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

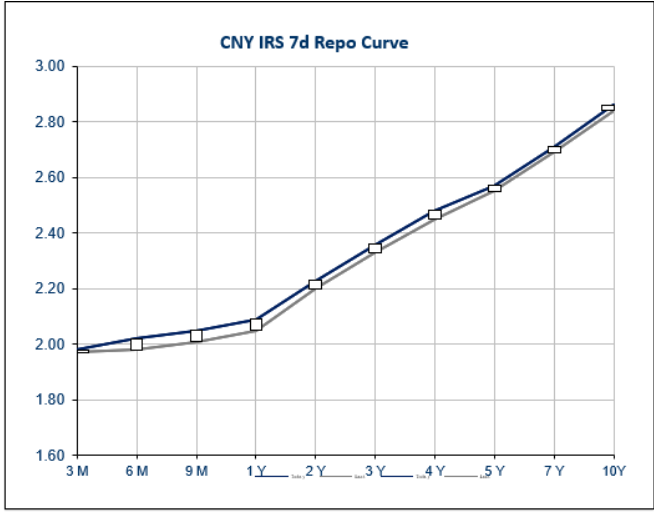
2022/11/10 Thursday

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	1.98	1				3 M	1.51	-									
6 M	2.02	4	6 M	2.03	5	6 M	1.58	-									
9 M	2.05	4	9 M	2.13	6	9 M	1.65	-									
1 Y	2.09	4	1 Y	2.22	6	1 Y	1.76	-				1Y	2.09	4			
2 Y	2.23	3	2 Y	2.46	6	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.23	3			
3 Y	2.36	3	3 Y	2.62	4	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.37	3			
4 Y	2.48	3	4 Y	2.79	3				4 Y	1.8	-	4Y	2.48	2			
5 Y	2.57	2	5 Y	2.94	3				5 Y	1.8	-	5Y	2.57	2			
7 Y	2.71	2	7 Y	3.14	3				7 Y	1.8	-						
10Y	2.86	2	10Y	3.29	3				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.90	-1.00	3M Shibor	1.838	3.10	O-N Shibor	1.826	1.80	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	3	2			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	3	-	10	1			
9M*1Y	4	-	9	-	6M	1	1
1*2Y	14	-1	24	-	9M	8	2
1*3Y	27	-1	40	-2	1Y	13	2
1*4Y	39	-1	57	-3	2Y	23	3
1*5Y	48	-2	72	-3	3Y	26	1
2*3Y	13	-	16	-2	4Y	31	-
2*4Y	25	-	33	-3	5Y	37	1
2*5Y	34	-1	48	-3			
3*4Y	12	-	17	-1			
3*5Y	21	-1	32	-1			
4*5Y	9	-1	15	-			
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	-6	19	4	33
今日	-8	18	4	32



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、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