



【2022-11-11】

中国央行今日进行 120 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 2.00%，与此前持平。今日逆回购到期 30 亿。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing:1.85%，比上一交易日减少 5bp；3m shibor fixing: 1.8680%，比上一交易日增加 3bp。

Repo 端，5y repo 早盘震荡成交在 2.5425%-2.565%区间附近，午盘报收 56.5/56.25；午后国债期货跳水，利率一路上行成交在 2.565%-2.615%，临近尾盘报收 61.5/61.25。1y repo 全天震荡成交在 2.05%-2.105%，报收。2y repo 成交 2.255%，4y repo 成交在 2.5075%-2.52%。曲线方面，1x2y repo 成交 15.75bp 附近，1x5y repo 成交在 49.25-51bp 附近，报收 51.25/50.75。

Shibor 端，6m shibor 成交在 2.04%附近，2y shibor 成交在 2.485%，1y shibor 成交在 2.1925%-2.26%附近，报收 26/24.5，5y shibor 成交在 2.925%，报收 99.75/98.25。曲线方面，6mx1y shibor 成交在 18.75bp 附近，1x2y shibor 成交在 23.5bp 附近，1x5 shibor 成交在 72.5bp 附近，1x5y shibor box 成交在 23.25bp 附近，基差方面，1y basis 成交在 15.75bp 附近，报收 15.75/14.5，2y basis 成交在 23bp 附近，5y basis 成交在 38bp 附近，报收 38.25/37。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

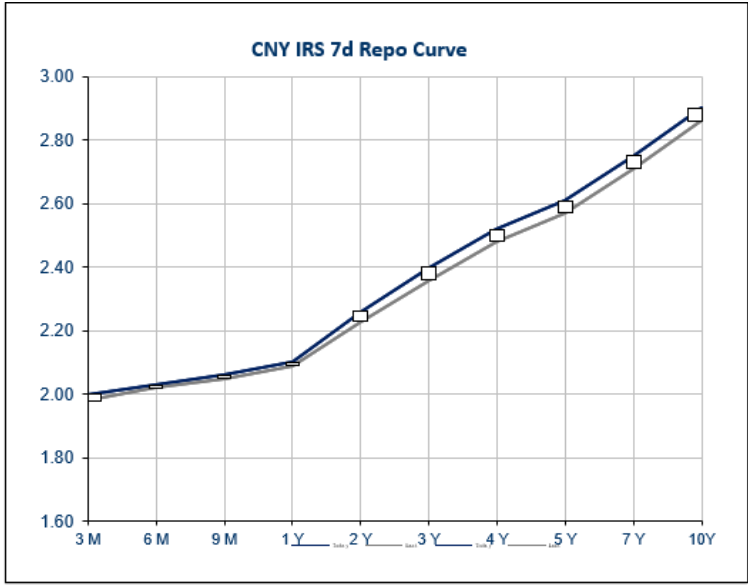
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2022/11/11 Friday

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	2				3 M	1.56	5									
6 M	2.03	1	6 M	2.05	2	6 M	1.63	5									
9 M	2.06	1	9 M	2.16	3	9 M	1.69	4									
1 Y	2.1	1	1 Y	2.25	3	1 Y	1.78	2				1Y	2.11	2			
2 Y	2.26	3	2 Y	2.49	3	2 Y	2.03	3	2 Y	1.65	-	2Y	2.26	3			
3 Y	2.4	4	3 Y	2.67	5	3 Y	2.03	3	3 Y	1.77	-	3Y	2.4	3			
4 Y	2.52	4	4 Y	2.84	5				4 Y	1.8	-	4Y	2.52	4			
5 Y	2.61	4	5 Y	2.99	5				5 Y	1.8	-	5Y	2.61	4			
7 Y	2.75	4	7 Y	3.19	5				7 Y	1.8	-						
10Y	2.9	4	10Y	3.34	5				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.85	-5.00	3M Shibor	1.868	3.00	O-N Shibor	1.704	-12.20	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	3	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	3	-	11	1				
9M*1Y	4	-	9	-	6M	2	1	
1*2Y	16	2	24	-	9M	10	2	
1*3Y	30	3	42	2	1Y	15	2	
1*4Y	42	3	59	2	2Y	23	-	
1*5Y	51	3	74	2	3Y	27	1	
2*3Y	14	1	18	2	4Y	32	1	
2*4Y	26	1	35	2	5Y	38	1	
2*5Y	35	1	50	2				
3*4Y	12	-	17	-				
3*5Y	21	-	32	-				
4*5Y	9	-	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	-8	18	4	32
今日	-8	17	3	30



联系人: Ruby Hu
邮箱: rubyhu@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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅供参考信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识仅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、投资策略任何交易策略相关的推介、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、及时性或准确性等要素, 且可能随时进行修订, 所有陈述和保证均按此免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN