



【2022-11-17】

中国央行今日进行 1320 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 90 亿。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing:1.95%，比上一交易日减少 8.13bp；3m shibor fixing: 2.2130%，比上一交易日增加 9.7bp。

Repo 端，5y repo 开盘在 2.82%-2.825%，后震荡成交在 2.805%-2.83%附近，午盘报收 80.25/80；午后国债期货震荡上行，互换利率一路下行成交在 2.795%-2.7475%，临近尾盘报收 75.5/75。1y repo 全天震荡成交在 2.235%-2.3225%。9m repo 成交在 2.2475%附近，2y repo 成交在 2.4025%-2.48%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在 4.75bp，1x2y repo 成交 16-17bp 附近，1x5y repo 报收 52.25/51.75。

Shibor 端，6m shibor 成交在 2.2875%，9m shibor 成交在 2.335%-2.345%，2y shibor 成交在 2.66%，1y shibor 成交在 2.41%-2.4825%，报收 42.75/42.25，5y shibor 成交在 3.13%-3.16%，报收 14/13。曲线方面，6mx1y shibor 成交在 13.75bp 附近，9x1y shibor 成交在 08bp 附近。基差方面，1y basis 成交在 17.25-19.5bp 附近，报收 19/18.5，5y basis 成交在 38.5bp 附近，报收 38.5/37.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

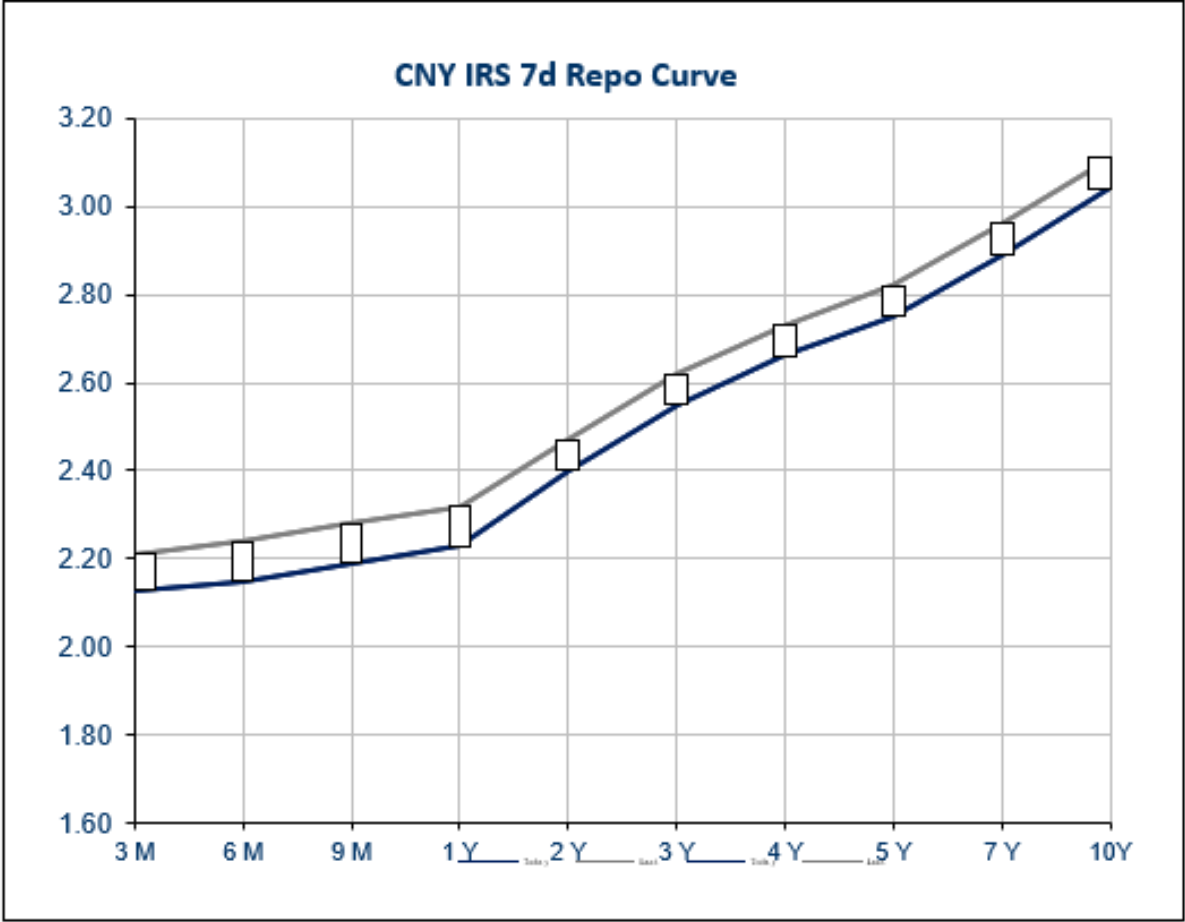
2022/11/17 Thursday

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-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	2.13	-8				3 M	1.71	5						
6 M	2.15	-9	6 M	2.3	-	6 M	1.78	5						
9 M	2.19	-9	9 M	2.36	-6	9 M	1.84	5						
1 Y	2.23	-9	1 Y	2.42	-8	1 Y	1.92	5				1Y	2.24	-8
2 Y	2.4	-7	2 Y	2.66	-7	2 Y	2	5	2 Y	1.65	-	2Y	2.4	-8
3 Y	2.55	-7	3 Y	2.83	-8	3 Y	2.03	5	3 Y	1.77	-	3Y	2.54	-8
4 Y	2.66	-7	4 Y	2.99	-8				4 Y	1.8	-	4Y	2.67	-6
5 Y	2.75	-7	5 Y	3.13	-8				5 Y	1.8	-	5Y	2.76	-6
7 Y	2.89	-7	7 Y	3.33	-8				7 Y	1.8	-			
10Y	3.04	-7	10Y	3.48	-8				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.95	-8.13	3M Shibor	2.213	9.70	0-N Shibor	1.699	-23.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	2	-1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	4	-	6	-6			
9M*1Y	4	-	6	-2	6M	15	9
1*2Y	17	2	24	1	9M	17	3
1*3Y	32	2	41	-	1Y	19	1
1*4Y	43	2	57	-	2Y	26	-
1*5Y	52	2	71	-	3Y	28	-1
2*3Y	15	-	17	-1	4Y	33	-1
2*4Y	26	-	33	-1	5Y	38	-1
2*5Y	35	-	47	-1			
3*4Y	11	-	16	-			
3*5Y	20	-	30	-			
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	-13	7	3	19
今日	-12	10	0	22



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