



【2022-11-04】

央行今日进行 30 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 2.00%，与此前持平。资金面整体均衡。7d repo fixing:1.68%，比上一交易日增加 3bp；3m shibor fixing: 1.7540%，比上一交易日多 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘震荡成交在 2.5125%-2.535%区间附近，午盘报收 53.75/53.25；午后股市强劲，国债期货跳水，上行成交在 2.53%-2.54%，临近尾盘报收 54.25/53.75。1y repo 全天成交在 1.995%-2.005%，报收 00.25/99.75，2y repo 成交 2.15%-2.155%，3y repo 成交在 2.43%。曲线方面陡峭明显，1x2 repo 成交 15.25-15.5bp 附近，4x5 repo 成交在 10.25bp 附近，1x5y repo 成交在 52-53.75bp 附近，报收 54/53.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.0775%，报收 08.75/08.25，5y shibor 成交在 2.86%，报收 88.25/87.75。曲线方面，1x5 shibor 成交在 78.25bp 附近。基差方面，1y basis 成交在 07.75bp 附近，报收 8.5/8，5y basis 成交在 34bp 附近，报收 34.5/34。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

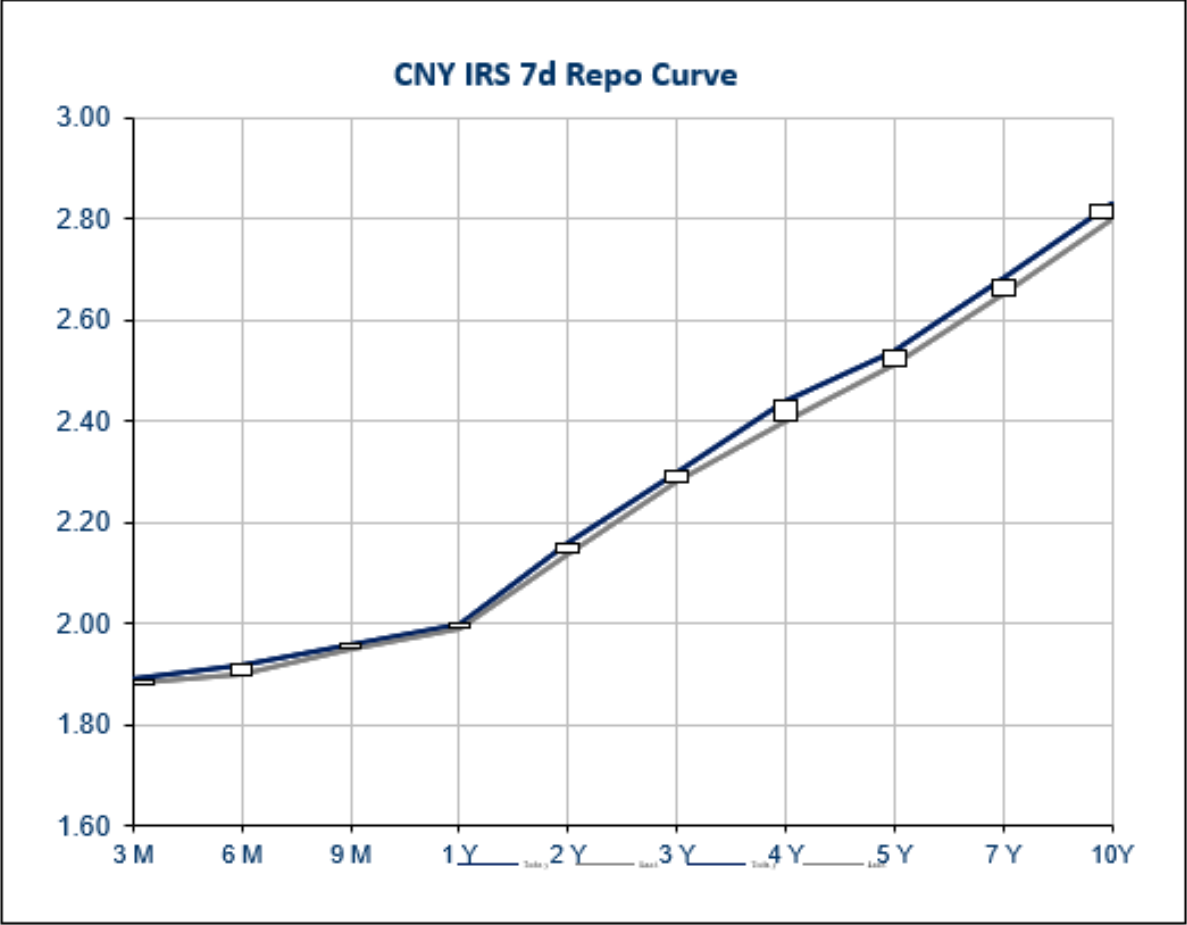
2022/11/4 Friday

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	1.89	1				3 M	1.51	–						
6 M	1.92	2	6 M	1.89	1	6 M	1.58	–						
9 M	1.96	1	9 M	1.99	1	9 M	1.65	–						
1 Y	2	1	1 Y	2.09	2	1 Y	1.76	–				1Y	1.99	3
2 Y	2.16	2	2 Y	2.34	2	2 Y	2	–	2 Y	1.65	–	2Y	2.16	4
3 Y	2.3	2	3 Y	2.53	3	3 Y	2	–	3 Y	1.77	–	3Y	2.31	5
4 Y	2.44	4	4 Y	2.72	3				4 Y	1.8	–	4Y	2.44	6
5 Y	2.54	3	5 Y	2.88	3				5 Y	1.8	–	5Y	2.52	6
7 Y	2.68	3	7 Y	3.08	3				7 Y	1.8	–			
10Y	2.83	3	10Y	3.23	3				10Y	1.8	–			
7D REPO	1.68	3.00	3M Shibor	1.754	0.20	0-N Shibor	1.386	6.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	3	1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	4	-1	10	–			
9M*1Y	4	–	10	1	6M	–3	-1
1*2Y	16	1	25	–	9M	3	–
1*3Y	30	1	44	1	1Y	9	1
1*4Y	44	3	63	1	2Y	18	–
1*5Y	54	2	79	1	3Y	23	1
2*3Y	14	–	19	1	4Y	28	-1
2*4Y	28	2	38	1	5Y	34	–
2*5Y	38	1	54	1			
3*4Y	14	2	19	–			
3*5Y	24	1	35	–			
4*5Y	10	-1	16	–			
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	-5	21	4	36
今日	-6	21	3	34



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