



【2022-11-09】

中国人民银行今日进行 80 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.00%，持平上次。今日有 180 亿元逆回购到期。资金面整体偏紧。7d repo fixing:1.91%，与上一交易日上升 7bp，3m shibor fixing: 1.8070%，与上一交易日上升 2.6bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.545%，后震荡成交在 2.5425%-2.55%区间附近，午盘报收 55.25/55。中午回来，期货震荡上行，5y repo 下行成交到 2.5375%，后又随期货波动，震荡成交在 2.54%-2.5475%区间附近，尾盘上行成交在 2.50%-2.555%区间附近，报收 55.25/55。全天 1y repo 随长端震荡成交在 2.0325%-2.0525%区间，报收 05.5/05.25。6m repo 成交在 1.96%附近，9m repo 成交在 1.995%-2.00%附近，2y repo 成交在 2.185%-2.195%附近，3y repo 成交在 2.3225%-2.335%附近。曲线方面，6mx1y 成交在 08bp 附近，9mx1y 成交在 04.5bp 附近，2x3y 成交在 13.5bp 附近，2x5y 成交在 35.5-36bp 附近，1x5y repo 成交在 50-50.5bp 附近，报收 50/49.5。

Shibor 端，9m shibor 成交在 2.045%附近，1y shibor 成交在 2.1575%-2.16%附近，报收 16.75/16.25，2y shibor 成交在 2.40%-2.405%附近，5y shibor 成交在 2.9125%附近，报收 91.75/91.25，曲线方面，2x5y 成交在 50.75bp 附近，1x5y 成交在 74-75.75bp 附近，基差方面，1y basis 成交在 11.25bp 附近，报收 11.25/11，5y basis 成交在 36bp 附近，报收 36.5/36.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

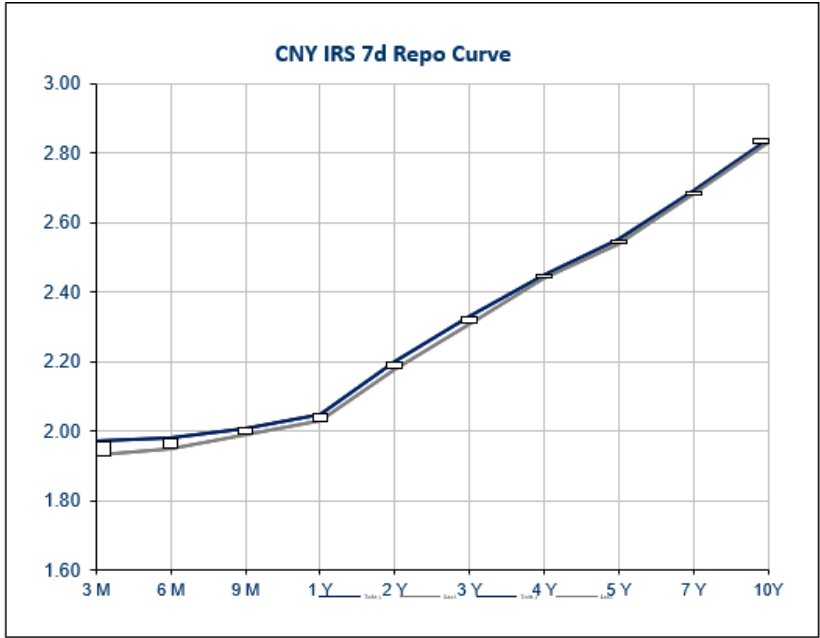
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
 2022/11/9 Wednesday

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	1.97	4				3 M	1.51	-						
6 M	1.98	3	6 M	1.98	5	6 M	1.58	-						
9 M	2.01	2	9 M	2.07	4	9 M	1.65	-						
1 Y	2.05	2	1 Y	2.16	3	1 Y	1.76	-				1Y	2.05	2
2 Y	2.2	2	2 Y	2.4	4	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.2	2
3 Y	2.33	2	3 Y	2.58	4	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.34	2
4 Y	2.45	1	4 Y	2.76	3				4 Y	1.8	-	4Y	2.46	2
5 Y	2.55	1	5 Y	2.91	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.55	2
7 Y	2.69	1	7 Y	3.11	2				7 Y	1.8	-			
10Y	2.84	1	10Y	3.26	2				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.91	7.00	3M Shibor	1.807	2.60	O-N Shibor	1.808	5.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	1 -1		Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	3 -1	9 -1			
9M*1Y	4 -	9 -1	6M	0	2
1*2Y	15 -	24 1	9M	6	2
1*3Y	28 -	42 1	1Y	11	1
1*4Y	40 -1	60 -	2Y	20	2
1*5Y	50 -1	75 -1	3Y	25	2
2*3Y	13 -	18 -	4Y	31	2
2*4Y	25 -1	36 -1	5Y	36	1
2*5Y	35 -1	51 -2			
3*4Y	12 -1	18 -1			
3*5Y	22 -1	33 -2			
4*5Y	10 -	15 -1			
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	-10	19	4	33
今日	-6	19	4	33



联系人: Ruby Hu
邮箱: xiaoting.hu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文宇旗收盘日报及更多资讯



免责声明:
以上所述及附加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或专有的信息, 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