



【2022-11-22】

中国央行今日开展 7 天期 20 亿元逆回购操作，因今日有 1720 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1700 亿元。资金面方面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.7111%，与上一交易日增加 1.11bp。3m shibor fixing: 2.2480%，比上一交易日增加 0.7bp。

今日，5y repo 开盘成交在 2.74%-2.735%，后期货下行，5y repo tkn 在 2.755%-2.765%区间成交。午后回来，5y repo 成交在 2.755%-2.7475%，后上行 tkn 在 2.765%位置成交。1y repo 成交在 2.22%-2.2275%，后下行成交在 2.2225%-2.215%区间。盘中 6m repo 成交在 2.12%；2y repo trd 2.405%-2.395%；3y repo 成交在 2.53%。曲线方面，6mx1y repo trd 10.75bp；1x2y repo spd 成交在 17.75-17.5bp；1x5y repo spd 成交在 53.5bp；2x5y repo spd trd 35.75bp；4x5y repo spd 成交在 10bp。

Shibor 方面，5y shibor 成交在 3.13%-3.135%。1y shibor 成交在 2.4475%-2.4425%。曲线方面，1x5y shibor spd 成交在 68.25bp。Basis 方面，1y s/r basis 成交在 22.5bp；5y s/r basis 成交在 38-37.75bp。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2022/11/22 Tuesday

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	2.06	-5				3 M	1.71	-						
6 M	2.12	-2	6 M	2.33	2	6 M	1.78	-						
9 M	2.17	-2	9 M	2.38	-	9 M	1.84	-						
1 Y	2.22	-1	1 Y	2.45	1	1 Y	1.92	-				1Y	2.22	-1
2 Y	2.4	-1	2 Y	2.66	-	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.4	-1
3 Y	2.55	-1	3 Y	2.83	1	3 Y	2.03	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.54	-1
4 Y	2.67	-	4 Y	2.99	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.66	-1
5 Y	2.76	-	5 Y	3.14	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.75	-1
7 Y	2.9	-	7 Y	3.32	-				7 Y	1.8	-			
10Y	3.05	-	10Y	3.47	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.7111	1.11	3M Shibor	2.248	0.70	O-N Shibor	0.871	-26.80	1Y DEPO	1.50				

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

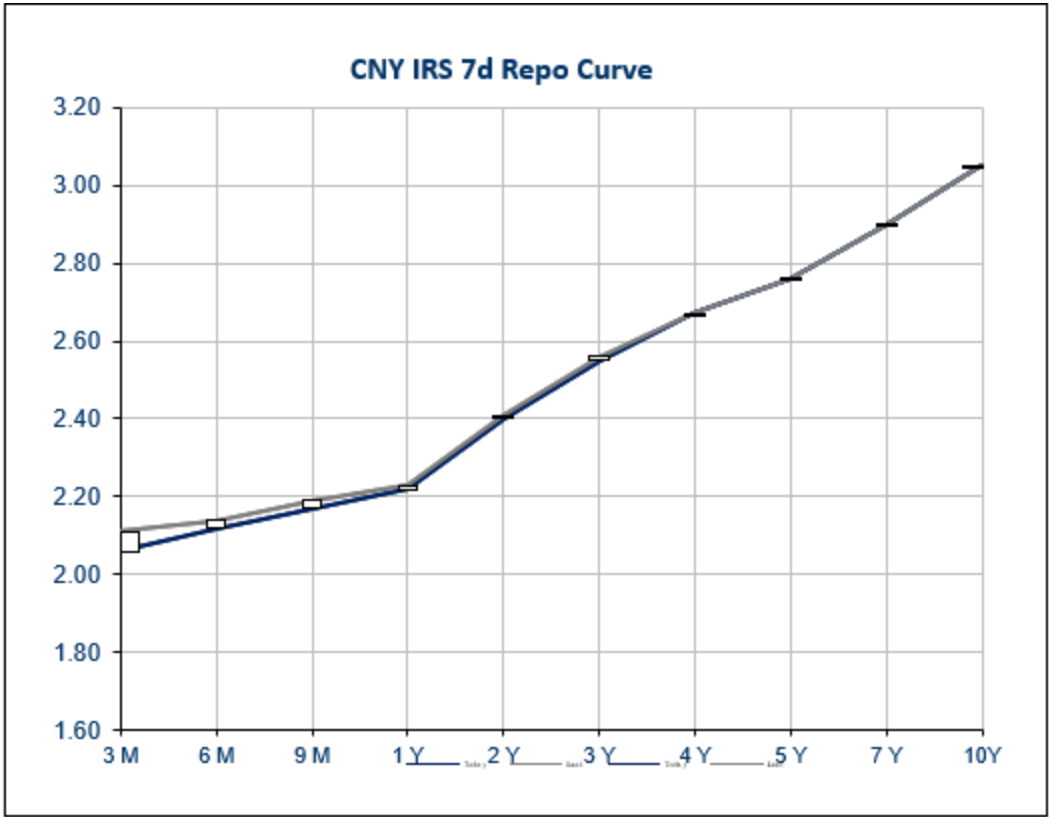
2022/11/22 Tuesday

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	2.06	-5				3 M	1.71	-						
6 M	2.12	-2	6 M	2.33	2	6 M	1.78	-						
9 M	2.17	-2	9 M	2.38	-	9 M	1.84	-						
1 Y	2.22	-1	1 Y	2.45	1	1 Y	1.92	-				1Y	2.22	-1
2 Y	2.4	-1	2 Y	2.66	-	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.4	-1
3 Y	2.55	-1	3 Y	2.83	1	3 Y	2.03	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.54	-1
4 Y	2.67	-	4 Y	2.99	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.66	-1
5 Y	2.76	-	5 Y	3.14	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.75	-1
7 Y	2.9	-	7 Y	3.34	2				7 Y	1.8	-			
10Y	3.05	-	10Y	3.49	2				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.7111	1.11	3M Shibor	2.248	0.70	O-N Shibor	0.871	-26.80	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO
3M*6M	6 3		Tenor	Mid Δ bp
6M*9M	5 -	5 -2		
9M*1Y	5 1	7 1	6M	21 4
1*2Y	18 -	21 -1	9M	21 2
1*3Y	33 -	38 -	1Y	23 2
1*4Y	45 1	54 -	2Y	26 1
1*5Y	54 1	69 1	3Y	28 2
2*3Y	15 -	17 1	4Y	32 1
2*4Y	27 1	33 1	5Y	38 2
2*5Y	36 1	48 2		
3*4Y	12 1	16 -		
3*5Y	21 1	31 1		
4*5Y	9 -	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	-14	12	-3	21
今日	-14	12	-4	22



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Wu
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、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