



【2022-12-05】

中国央行今日开展 7 天期 20 亿元逆回购操作，因今日有 550 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 530 亿元。早盘资金面缓和偏松，午后继续维持均衡状态。7d repo fixing: 1.70%，与上一交易日持平。3m shibor fixing: 2.201%，比上一交易日上升 0.1bp。

repo 端，早盘情绪温和，5y repo 开盘成交在 2.7925%，国债期货开盘后窄幅震荡，5y repo 成交在 2.7925%后一路上行 tkn 至 2.805%附近，午盘小幅下行，报收 79.5/79。午后市场浮动依旧保持稳定，5y repo tkn 2.795%后小幅上行，成交区间在 2.795%-2.8075%，尾盘受消息面影响，成交上行至 2.815%-2.8225%区间，报收 82.5/82。1y repo 开盘成交在 2.2325%，后价格一直维稳在此水平。午盘前价格下行，成交在 2.2225%，报收 22.5/22。午后 1y repo 价格有所回升但成交较少，成交位置集中在 2.2325%、2.235%，全天成交在 2.2225%-2.235%区间，受消息面影响，尾盘报收上行至 24.5/24.25。盘中 9m repo 成交在 2.1775%，2y repo 成交 2.43%-2.44%，4y repo 成交在 2.715%。曲线方面稍有陡峭，9mx1y repo spd 成交 5.75bp，1x2 repo spd 成交 19.75bp，2x5 repo spd 成交 38bp，4x5 repo spd 成交 10bp，1x5 repo spd 成交 57bp-57.5bp，报收 58.25/57.75。

Shibor 方面，1y shibor 上午成交 2.43%，尾盘上行 报收 45/44。5y shibor 报收 19/18。曲线方面，1x5y Shibor 报收 74.5/73。Basis 方面，1y basis 成交 20.5bp-20bp，报收 20.5/19.75，5y basis 报收 37.75/36.5。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

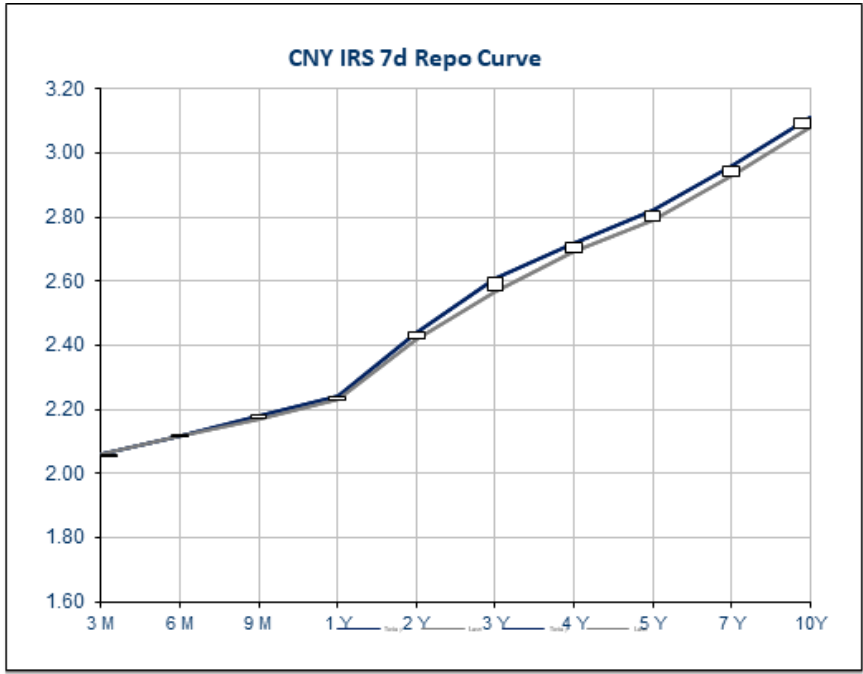
2022/12/5 星期一

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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.06	-				3 M	1.66	-						
6 M	2.12	-	6 M	2.3	2	6 M	1.8	-						
9 M	2.18	1	9 M	2.36	1	9 M	1.88	-						
1 Y	2.24	1	1 Y	2.44	2	1 Y	1.91	-				1Y	2.25	4
2 Y	2.44	2	2 Y	2.69	2	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.46	5
3 Y	2.61	4	3 Y	2.87	3	3 Y	2.01	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.61	4
4 Y	2.72	3	4 Y	3.04	3				4 Y	1.8	-	4Y	2.73	4
5 Y	2.82	3	5 Y	3.19	3				5 Y	1.8	-	5Y	2.82	4
7 Y	2.96	3	7 Y	3.39	3				7 Y	1.8	-			
10Y	3.11	3	10Y	3.54	3				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.70	-	3M Shibor	2.201	0.10	O-N Shibor	1.08	-7.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	6	-			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	6	1	6	-1			
9M*1Y	6	-	8	1	6M	18	2
1*2Y	20	1	25	-	9M	18	-
1*3Y	37	3	43	1	1Y	20	1
1*4Y	48	2	60	1	2Y	25	-
1*5Y	58	2	75	1	3Y	26	-1
2*3Y	17	2	18	1	4Y	32	-
2*4Y	28	1	35	1	5Y	37	-
2*5Y	38	1	50	1			
3*4Y	11	-1	17	-			
3*5Y	21	-1	32	-			
4*5Y	10	-	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	220022/5y repo	220019/5y repo	220203/5y repo	220215/5y repo
昨日	-14	11	0	23
今日	-15	11	1	23



联系人: Ruby Yu
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:

以上所宜及附加的所有信息 (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、及时性或准确性等要求, 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