



【2022-12-01】

中国央行今日开展 100 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 80 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 20 亿元，资金面均衡。7d repo fixing: 1.75%，与上一交易下降 45bp。3m shibor fixing: 2.197%，比上一交易日上升 0.4bp。

repo 端，早盘延续弱势情绪，5y repo 开盘成交在 2.845%，国债期货开盘后表现强势，5y repo 最低 gvn 至 2.805%，午盘稍有回升至 81.5/81 收盘，午后市场延续震荡向下格局，5y repo 成交 2.82%-2.795%区间，临近尾盘 gvn 至 2.79%，2.7875%等位置，报收 79/78.5。1y repo 受 fixing 牵扯，早盘下行趋势明显，全天成交在 2.2525%-2.2225%区间。2y repo 成交 2.4325%，9m repo 成交 2.18%，曲线方面，先陡后平 1x5 repo 成交 57.5bp-56.75bp，报收 56.5/56。1x2 repo spd 成交 19.25bp，19.5bp 等位置。9mx1y repo spd 成交 05.75bp。

Shibor 方面，1y shibor 成交在 2.43%-2.435%，报收 42.5/42，5y shibor 成交在 3.175%，报收 16.25/15。曲线方面，1x5y Shibor 成交在 74bp，报收 74.25/73。Basis 方面，1y basis 报收 20/19.5，5y basis 成交在 36，报收 37.25/36.5。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2022/12/1 Thursday

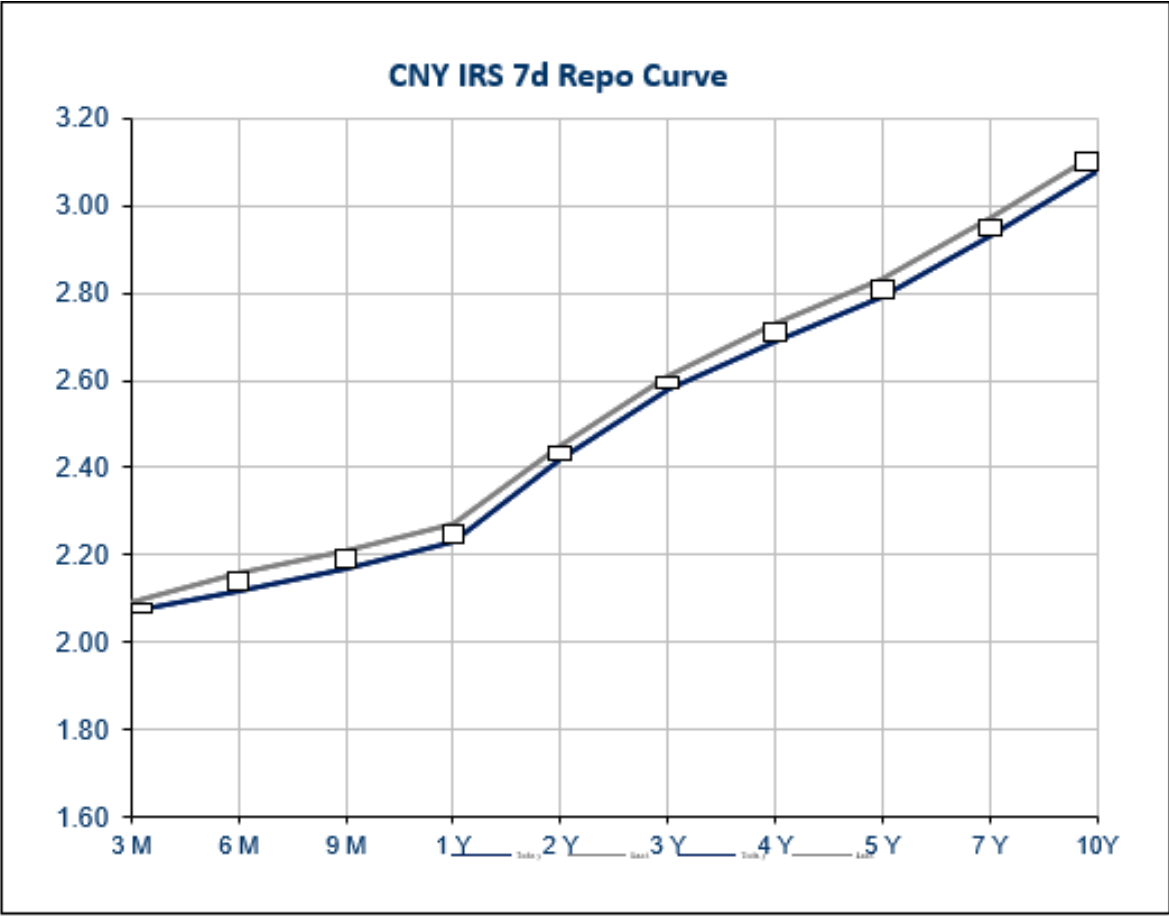
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365		
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	2.07	-2				3 M	1.66	-						
6 M	2.12	-4	6 M	2.28	-3	6 M	1.8	-						
9 M	2.17	-4	9 M	2.36	-2	9 M	1.88	-						
1 Y	2.23	-4	1 Y	2.43	-2	1 Y	1.91	-				1Y	2.22	-5
2 Y	2.42	-3	2 Y	2.66	-3	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.42	-4
3 Y	2.58	-3	3 Y	2.84	-4	3 Y	2.01	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.58	-5
4 Y	2.69	-4	4 Y	3.01	-4				4 Y	1.8	-	4Y	2.7	-5
5 Y	2.79	-4	5 Y	3.16	-4				5 Y	1.8	-	5Y	2.78	-6
7 Y	2.93	-4	7 Y	3.36	-4				7 Y	1.8	-			
10Y	3.08	-4	10Y	3.51	-4				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.75	-45.00	3M Shibor	2.197	0.40	0-N Shibor	1.458	-5.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	5	-2			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	5	-	8	1			
9M*1Y	6	-	7	-	6M	16	1
1*2Y	19	1	23	-1	9M	19	2
1*3Y	35	1	41	-2	1Y	20	2
1*4Y	46	-	58	-2	2Y	24	-
1*5Y	56	-	73	-2	3Y	26	-1
2*3Y	16	-	18	-1	4Y	32	-
2*4Y	27	-1	35	-1	5Y	37	-
2*5Y	37	-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	-15	8	0	21
今日	-13	11	0	23



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