



【2022-11-16】

中国央行今日进行 710 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.00%，持平上次。今日有 80 亿元逆回购到期。资金面整体偏紧。7d repo fixing:2.0313%，与上一交易日上升 3.13bp，3m shibor fixing: 2.1160%，与上一交易日上升 10.7bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.735%-2.74%，稍微下行成交到 2.72%后，一路震荡上行，成交在 2.735 %-2.76%区间附近，午盘报收 76.5/76.25。中午回来，期货大幅下行，5y repo 随期货大幅上行成交到 2.8575%附近，后稍微回调，在 2.82%-2.84%区间来回成交，报收 82.75/82。1y repo 上午震荡上行，成交在 2.21%-2.265%区间附近，下午开盘后，1y repo 随 5y 大幅上行，成交在 2.26%-2.355%区间附近，报收 32.5/32。2y repo 成交在 2.3625%-2.4875%附近，3y repo 成交在 2.535%-2.55%附近。曲线方面，1x2y 成交在 15-15.25bp 附近，3x5y 成交在 20.75bp-21.5bp 附近，1x5y repo 成交在 49-50bp 附近，报收 50.25/49.75。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.37%-2.465%区间附近，报收 50.75/48.75，5y shibor 成交在 3.155%-3.2225%附近，报收 22/21，基差方面，1y basis 成交在 15.5-17.5bp 附近，报收 18.5/16.5，5y basis 成交在 39.5-39.75bp 附近，报收 39.5/39。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2022/11/16

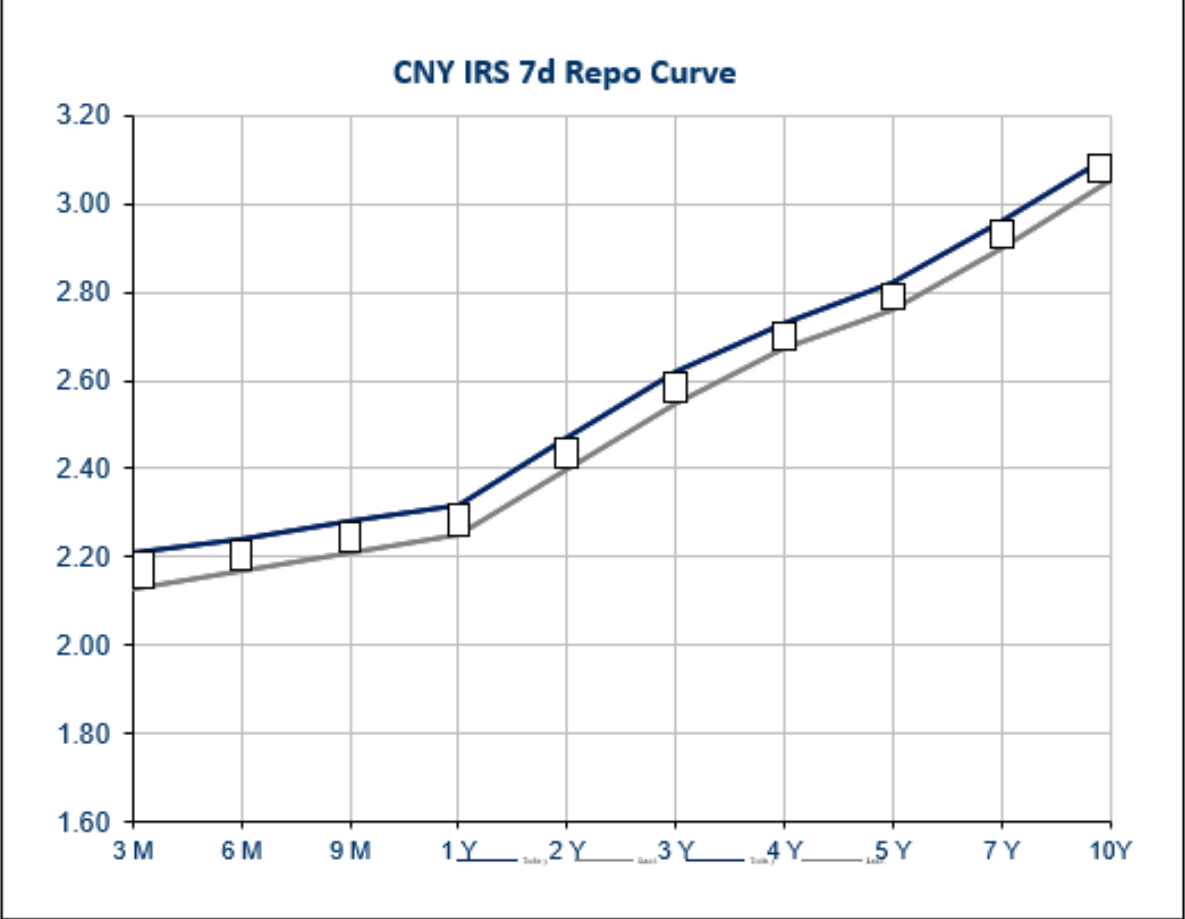
Wednesday

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	2.21	8				3 M	1.66	5						
6 M	2.24	7	6 M	2.3	10	6 M	1.73	5						
9 M	2.28	7	9 M	2.42	10	9 M	1.79	5						
1 Y	2.32	7	1 Y	2.5	9	1 Y	1.87	5				1Y	2.32	7
2 Y	2.47	7	2 Y	2.73	8	2 Y	1.95	-3	2 Y	1.65	-	2Y	2.48	7
3 Y	2.62	7	3 Y	2.91	7	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.62	6
4 Y	2.73	6	4 Y	3.07	6				4 Y	1.8	-	4Y	2.73	6
5 Y	2.82	6	5 Y	3.21	6				5 Y	1.8	-	5Y	2.82	6
7 Y	2.96	6	7 Y	3.41	6				7 Y	1.8	-			
10Y	3.11	6	10Y	3.56	6				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.0313	3.13	3M Shibor	2.116	10.70	0-N Shibor	1.936	8.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	3	-1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	4	-	12	-			
9M*1Y	4	-	8	-1	6M	6	3
1*2Y	15	-	23	-1	9M	14	3
1*3Y	30	-	41	-2	1Y	18	2
1*4Y	41	-1	57	-3	2Y	26	1
1*5Y	50	-1	71	-3	3Y	29	-
2*3Y	15	-	18	-1	4Y	34	-
2*4Y	26	-1	34	-2	5Y	39	-
2*5Y	35	-1	48	-2			
3*4Y	11	-1	16	-1			
3*5Y	20	-1	30	-1			
4*5Y	9	-	14	-			
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	11	4	22
今日	-13	7	3	19



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