

收盘日评 银行间利率衍生品市场

常规报告系列

15th
CFETS-NEX
上海国际货币经纪15周年
Anniversary 2007-2022

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2022-11-08】

中国人民银行今日开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，今日有 150 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 130 亿元。资金面方面整体均衡。7d repo fixing: 1.84%，与上一交易日增加 9bp。3m shibor fixing: 1.7810%，比上一交易日增加 1.2bp。

今日，5y repo 开盘成交在 2.5575%-2.565%。午后回来，5y repo gvn 在 2.5575%-2.5525% 区间成交，后期货上行，5y repo 下行成交在 2.54%-2.5325%。1y repo 震荡成交在 2.045%-2.0375%，后下行成交在 2.03%-2.025%。盘中 3m repo 成交在 1.9325%-1.94%；6m repo trd 1.96%；2y repo 成交在 2.1975%-2.1725%；3y repo 成交在 2.33%-2.34%，4y repo trd 2.465%-2.44%。曲线方面，6mx1y repo spd 成交在 8.25bp；9mx1y repo spd 成交在 4bp；1x2y repo trd 15bp；2x3y repo spd 成交在 14.25-13.75bp；1x5y repo spd 成交在 51.5-51bp；4x5y repo spd 成交在 9.75bp。

Shibor 今日成交清淡，5y shibor 成交在 2.9025%。1y shibor 成交在 2.135%-2.14%。Basis 方面，1y s/r basis 成交在 9.25-10bp；5y s/r basis 成交在 34.5bp。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

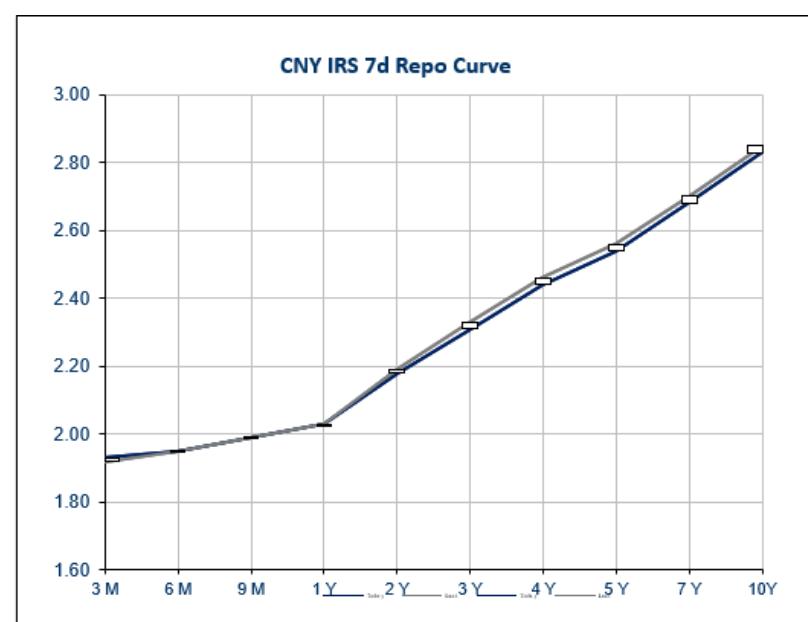
2022/11/8 Tuesday

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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	
3 M	1.93	1				3 M	1.51	-							
6 M	1.95	-	6 M	1.93	1	6 M	1.58	-							
9 M	1.99	-	9 M	2.03	1	9 M	1.65	-							
1 Y	2.03	-	1 Y	2.13	1	1 Y	1.76	-				1Y	2.03	-	
2 Y	2.18	-1	2 Y	2.36	-	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.18	-1	
3 Y	2.31	-2	3 Y	2.54	-1	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.32	-2	
4 Y	2.44	-2	4 Y	2.73	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.44	-2	
5 Y	2.54	-2	5 Y	2.89	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.53	-2	
7 Y	2.68	-2	7 Y	3.09	-1				7 Y	1.8	-				
10Y	2.83	-2	10Y	3.24	-1				10Y	1.8	-				
7D REPO	1.84	9.00	3M Shibor	1.781	1.20	O-N Shibor	1.756	13.60	1Y DEPO	1.50					

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
			Tenor	Mid	Δbp	
3M*6M	2	-1				
6M*9M	4	-	10	-		
9M*1Y	4	-	10	-	6M	-2
1*2Y	15	-1	23	-1	9M	4
1*3Y	28	-2	41	-2	1Y	10
1*4Y	41	-2	60	-2	2Y	18
1*5Y	51	-2	76	-2	3Y	23
2*3Y	13	-1	18	-1	4Y	29
2*4Y	26	-1	37	-1	5Y	35
2*5Y	36	-1	53	-1		
3*4Y	13	-	19	-		
3*5Y	23	-	35	-		
4*5Y	10	-	16	-		
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	-7	18	3	32
今日	-10	19	4	33



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:

以上所述及列出的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供口提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国际市场经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融投资或任何交易策略相关的推介、定价、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。所有陈述和保证均按原状免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN