



【2022-12-06】

中国央行今日开展 7 天期 20 亿元逆回购操作，因今日有 800 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 780 亿元。7d repo fixing: 1.66%，较昨日下降 4bp。3m shibor fixing: 2.207%，比上一交易日上升 0.6bp。

repo 端，早盘受疫情消息面影响，5y repo 开盘 tkn 2.825%后持续走高。国债期货开盘跳水，5y repo 一路上行成交，成交区间 2.855%附近，午盘报收 85.5/85。午后市场持续小幅波动，5y repo gvn 2.8525%后震荡上升，成交区间在 2.8525%-2.86%，尾盘受理财赎回影响，成交上行至 2.8775%，报收 88.5/88。1y repo 开盘成交 2.2525%后价格小幅上行，最高 gvn 至 2.2575%后回落，午盘报收 25.25/25。午后 1y repo 价格维稳、成交较少，成交位置集中在 2.255%位置，全天成交在 2.25%-2.2575%区间，尾盘受理财方面影响，成交价格上行至 2.275%-2.2775%区间，报收 28/27.5。盘中 6m repo 成交 2.14%，2y repo 成交 2.47%，4y repo 成交在 2.755%、2.7575%、2.765%。曲线方面，6mx1y repo spd 成交 11.5bp，4x5 repo spd 成交 9.75bp，1x5 repo spd 成交 59.5bp-60bp，报收 60.75/60.25。

Shibor 方面，成交较少。1y shibor 报收 50.5/49.5。2y shibor 成交 72，报收 77/75。5y shibor 报收 28/27。曲线方面，1x5y Shibor 报收 77.5/76.5。Basis 方面，1y basis 报收 22.75/21.5。2y basis 成交 25，报收 28/26，5y basis 报收 40/38.5。

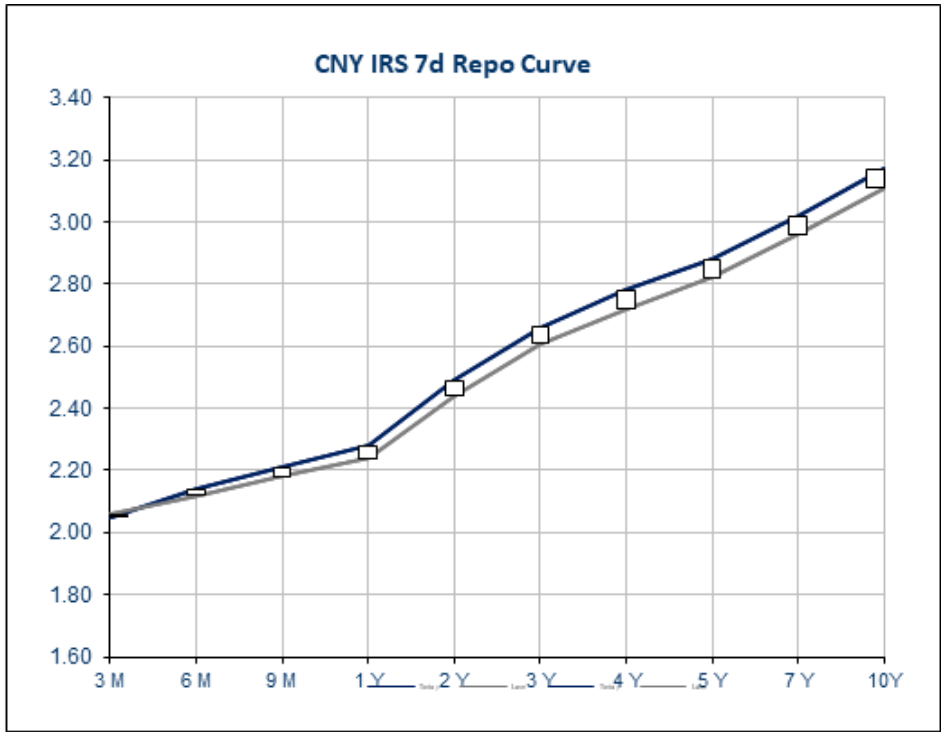
其他方面，报价寥寥未闻成交。
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2022/12/6 星期二

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	2.05	-1				3 M	1.66	-						
6 M	2.14	2	6 M	2.34	4	6 M	1.8	-						
9 M	2.21	3	9 M	2.43	7	9 M	1.88	-						
1 Y	2.28	4	1 Y	2.5	6	1 Y	1.91	-				1Y	2.28	3
2 Y	2.49	5	2 Y	2.75	6	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.5	4
3 Y	2.66	5	3 Y	2.95	8	3 Y	2.01	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.67	6
4 Y	2.78	6	4 Y	3.13	9				4 Y	1.8	-	4Y	2.8	7
5 Y	2.88	6	5 Y	3.27	8				5 Y	1.8	-	5Y	2.88	6
7 Y	3.02	6	7 Y	3.47	8				7 Y	1.8	-			
10Y	3.17	6	10Y	3.62	8				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.66	-4.00	3M Shibor	2.207	0.60	O-N Shibor	1.043	-3.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	9	3			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	7	1	9	3			
9M*1Y	7	1	7	-1	6M	20	2
1*2Y	21	1	25	-	9M	22	4
1*3Y	38	1	45	2	1Y	22	2
1*4Y	50	2	63	3	2Y	26	1
1*5Y	60	2	77	2	3Y	29	3
2*3Y	17	-	20	2	4Y	35	3
2*4Y	29	1	38	3	5Y	39	2
2*5Y	39	1	52	2			
3*4Y	12	1	18	1			
3*5Y	22	1	32	-			
4*5Y	10	-	14	-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	220022/5y	220019/5y	220203/5y	220215/5y
Swap	repo	repo	repo	repo
昨日	-15	11	1	23
今日	-16	13	0	19



联系人: Ruby Hu
邮箱: xiaoting.hu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日报及更多资讯



免责声明:

以上所述及附加的所有信息 (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推介、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审慎免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN