



【2022-05-27】

今日，央行公开市场开展 100 亿 7 天期逆回购操作，有 100 亿元 7 天期逆回购到期，当日资金零投放零回笼。资金面整体偏松。7d repo fixing:1.85%,与上一交易日下降 02bp, 3m shibor fixing: 1.995%,与上一交易增加 0.5bp。

数据方面，1-4 月中国规模以上工业企业利润同比增 3.5%。

Repo 端，5y repo 率先成交在 2.46%，后震荡成交在 2.46%-2.47%区间，午盘报收 46.5/46，中午回来， 5y repo 下降成交在 2.4675%-2.445%区间附近，尾盘略有上行，报收 46/45.5。全天 1y repo 随长端震荡成交在 2.0425%-2.0225%区间附近，报收 03.5/03。9m repo 成交在 1.995%，2y repo 成交在 2.1525%-2.14%附近, 3y repo 成交在 2.26%-2.2625%。曲线方面，1x3y 成交在 22.25bp 附近，4x5y 成交在 9bp，1x5y 成交在 42.5-42.25bp 附近， 报收 42.5/42.25。

Shibor 端。1y shibor 成交在 2.3025%-2.29%附近，报收 30.5/29.75，5y shibor 成交在 2.8575%-2.84%附近，报收 86/84.75，2y shibor 成交在 2.465%-2.4675%，3y shibor 成交在 2.6025%-2.585%，曲线方面，1x3y shibor 成交在 29.5-30bp 附近，1x5y shibor 成交在 55.25-55.5bp 附近。基差方面，1y basis 报收 27.25/26.75，5y basis 成交在 39.5-39bp，报收 40/39.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2022/5/27 Friday

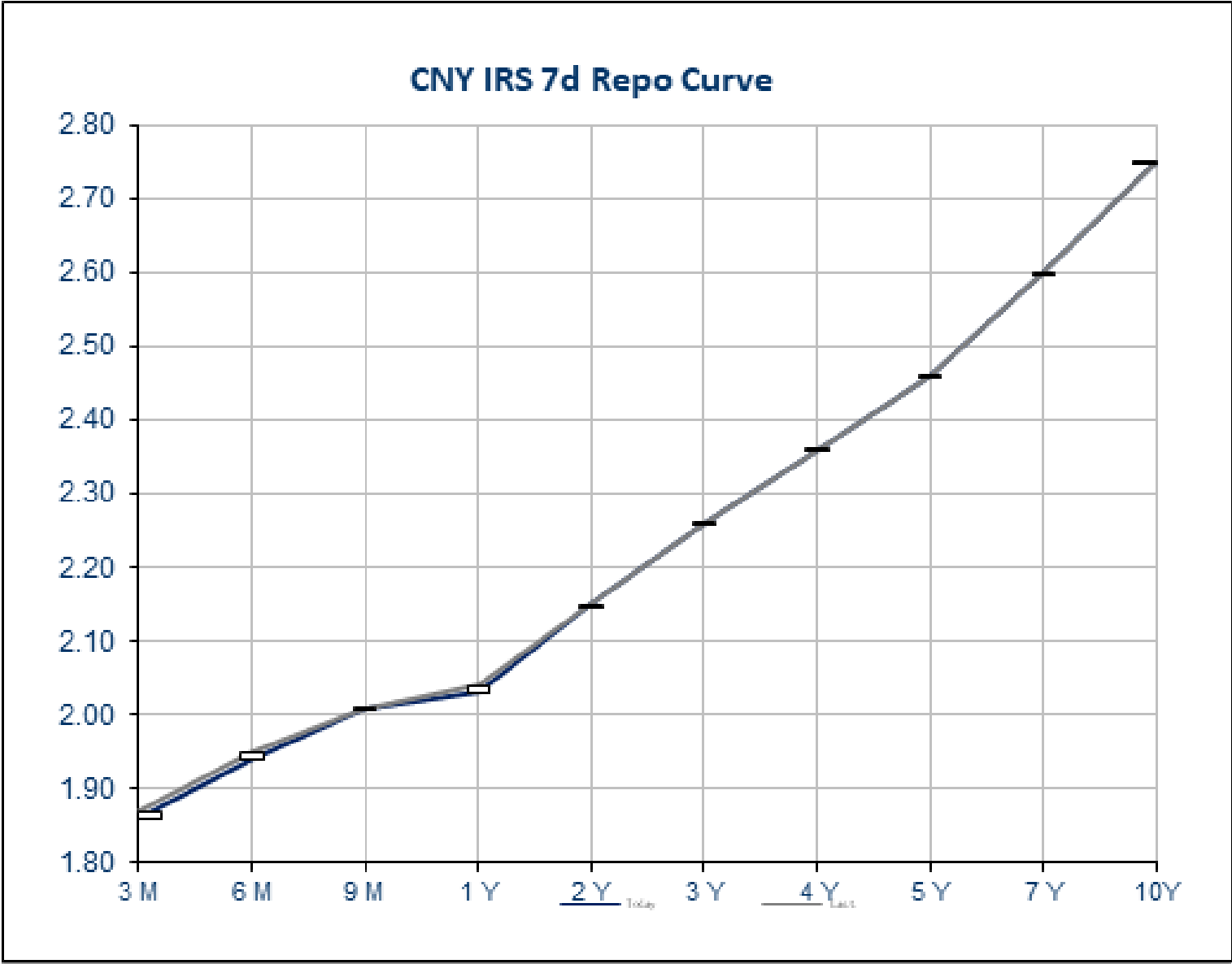
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1.86	-1				3 M	1.78	-						
6 M	1.94	-1	6 M	2.12	-1	6 M	1.85	-						
9 M	2.01	-	9 M	2.23	-	9 M	1.91	-						
1 Y	2.03	-1	1 Y	2.30	-	1 Y	1.95	-				1Y	1.98	-
2 Y	2.15	-	2 Y	2.47	-	2 Y	2.05	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.07	-
3 Y	2.26	-	3 Y	2.59	-	3 Y	2.06	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.17	-
4 Y	2.36	-	4 Y	2.73	-				4 Y	1.80	-	4Y	2.25	-1
5 Y	2.46	-	5 Y	2.85	-				5 Y	1.80	-	5Y	2.31	-
7 Y	2.60	-	7 Y	3	-				7 Y	1.80	-			
10Y	2.75	-	10Y	3.17	-				10Y	1.80	-			
7D REPO	1.85	-2.00	3M Shibor	1.995	0.50	O-N Shibor	1.381	1.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	8	-			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	7	1	11	1			
9M*1Y	2	-1	7	-	6M	18	-
1*2Y	12	1	17	-	9M	22	-
1*3Y	23	1	29	-	1Y	27	-
1*4Y	33	1	43	-	2Y	32	-
1*5Y	43	1	55	-	3Y	33	-
2*3Y	11	-	12	-	4Y	37	-
2*4Y	21	-	26	-	5Y	39	-
2*5Y	31	-	38	-			
3*4Y	10	-	14	-			
3*5Y	20	-	26	-			
4*5Y	10	-	12	-			

5*7Y	14	-	15	-		
5*10Y	29	-	32	-		

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	73	72	72	70	73	73	76
今日	73	72	72	70	73	73	76

Bond Swap	210011/5y repo	210017/5y repo	220205/5y repo	220210/5y repo
昨日	2	32	57	47
今日	2	32	58	48



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