



【2022-05-19】

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。资金面整体均衡。7d repo fixing:1.60%,与上一交易日下降 02bp, 3m shibor fixing: 2.0670%,与上一交易日减少 1.1bp。

Repo 端，5y repo 率先成交在 2.4875%，后震荡成交在 2.4875%-2.4975%区间，午盘报收 50/49.5，中午回来， 5y repo 成交在 2.5025%-2.5125%区间,报收 51.25/51。全天 1y repo 随长端震荡成交在 2.0575%-2.0775%区间附近,报收 07.5/07， 2y repo 成交在 2.165%-2.1825%附近， 3y repo 成交在 2.6725%，曲线方面，6mx9m repo 成交在 06bp 附近， 1x5y 成交在 43-43.5bp 附近， 报收 43.75/43.5。

Shibor 端。1y shibor 成交在 2.3125%-2.325%附近，报收 32.5/32， 5y shibor 成交在 2.885%-2.90%附近，报收 90/89.25， 9m shibor 成交在 2.25%-2.255%附近， 2y shibor 成交在 2.48%-2.4925%， 3y shibor 成交在 2.6275%附近，曲线方面，9mx1y shibor 成交在 06.25bp， 2x5y shibor 成交在 40bp 附近，基差方面，1y basis 报收 25.25/24.75。2y basis 成交在 31bp， 3y basis 成交在 32.5bp， 5y basis 成交在 38.5 附近，报收 38.75/38.25

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2022/5/19 Thursday

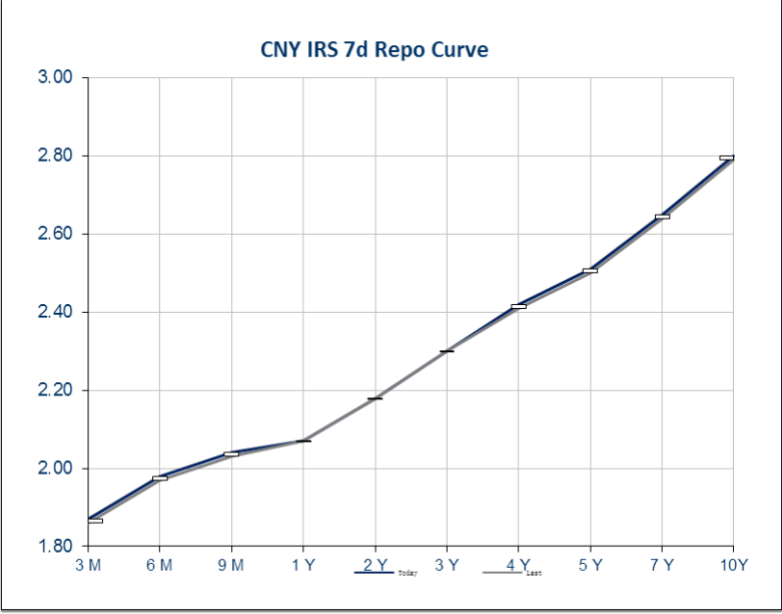
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365		
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.87	1				3 M	1.74	-						
6 M	1.98	1	6 M	2.18	-	6 M	1.83	-						
9 M	2.04	1	9 M	2.26	1	9 M	1.90	-1						
1 Y	2.07	-	1 Y	2.32	-	1 Y	1.94	-1				1Y	2.03	1
2 Y	2.18	-	2 Y	2.49	-	2 Y	2.08	-4	2 Y	1.65	-	2Y	2.13	-
3 Y	2.30	-	3 Y	2.63	-	3 Y	2.09	-4	3 Y	1.77	-	3Y	2.23	-1
4 Y	2.42	1	4 Y	2.77	-				4 Y	1.80	-	4Y	2.32	-1
5 Y	2.51	1	5 Y	2.89	-				5 Y	1.80	-	5Y	2.38	-1
7 Y	2.65	1	7 Y	3.04	-				7 Y	1.80	-			
10Y	2.80	1	10Y	3.21	-				10Y	1.80	-			
7D REPO	1.60	-2.00	3M Shibor	2.067	-1.10	0-N Shibor	1.414	8.80	1Y DEPO	1.50				

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	11	-			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	6	-	8	1			
9M*1Y	3	-1	6	-1	6M	20	-1
1*2Y	11	-	17	-	9M	22	-
1*3Y	23	-	31	-	1Y	25	-
1*4Y	35	1	45	-	2Y	31	-
1*5Y	44	1	57	-	3Y	33	-
2*3Y	12	-	14	-	4Y	35	-1
2*4Y	24	1	28	-	5Y	38	-1
2*5Y	33	1	40	-			
3*4Y	12	1	14	-			
3*5Y	21	1	26	-			
4*5Y	9	-	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	210215/5y repo	220205/5y repo
昨日	2	33	60	56
今日	2	33	60	56



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Hu
邮箱: xiating.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:

以上所登及附送的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 不为任何投资建议, 其知识产归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任何可金融工具、期货或任何交易策略相关的报价、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, 后可能通知而进行修改, 所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN