



【2022-06-2】

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。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing:1.65%,与上一交易日上升 01bp，3m shibor fixing: 1.9990%,与上一交易日增加 0.1bp。

Repo 端，5y repo 率先成交在 2.5375%，后震荡成交在 2.5375%-2.525%区间，午盘报收 53.75/53.25，中午回来，5y repo 成交在 2.5225%-2.5525%区间附近，报收 54.25/53.75。全天 1y repo 随长端震荡成交在 2.1025%-2.08%区间,报收 09.75/09.25。3m repo 成交在 1.875%-1.885%附近 6m repo 成交在 1.97%-1.99%，9m repo 成交在 2.05%-2.075%，曲线方面，3x6m 成交在 10.5bp 附近，6mx1y 成交 11.75bp，1x5y 成交在 44.5bp 附近，报收 44.75/44.25。

Shibor 端。6m shibor 成交在 2.1625%-2.15%，9m shibor 成交在 2.27%-2.2625%，1y shibor 成交在 2.365%-2.3425%附近，报收 36/35.25，5y shibor 成交在 2.955%-2.9575%附近，报收 95/94.25，曲线方面，6mx1y shibor 成交在 19bp 附近，9x1y shibor 成交在 11.25bp，1x5y shibor 成交在 59.75-60bp。基差方面，9m basis 成交在 22.25bp，1y basis 报收 26/25.5，5y basis 成交了 41.25bp，报收 41.25/40.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

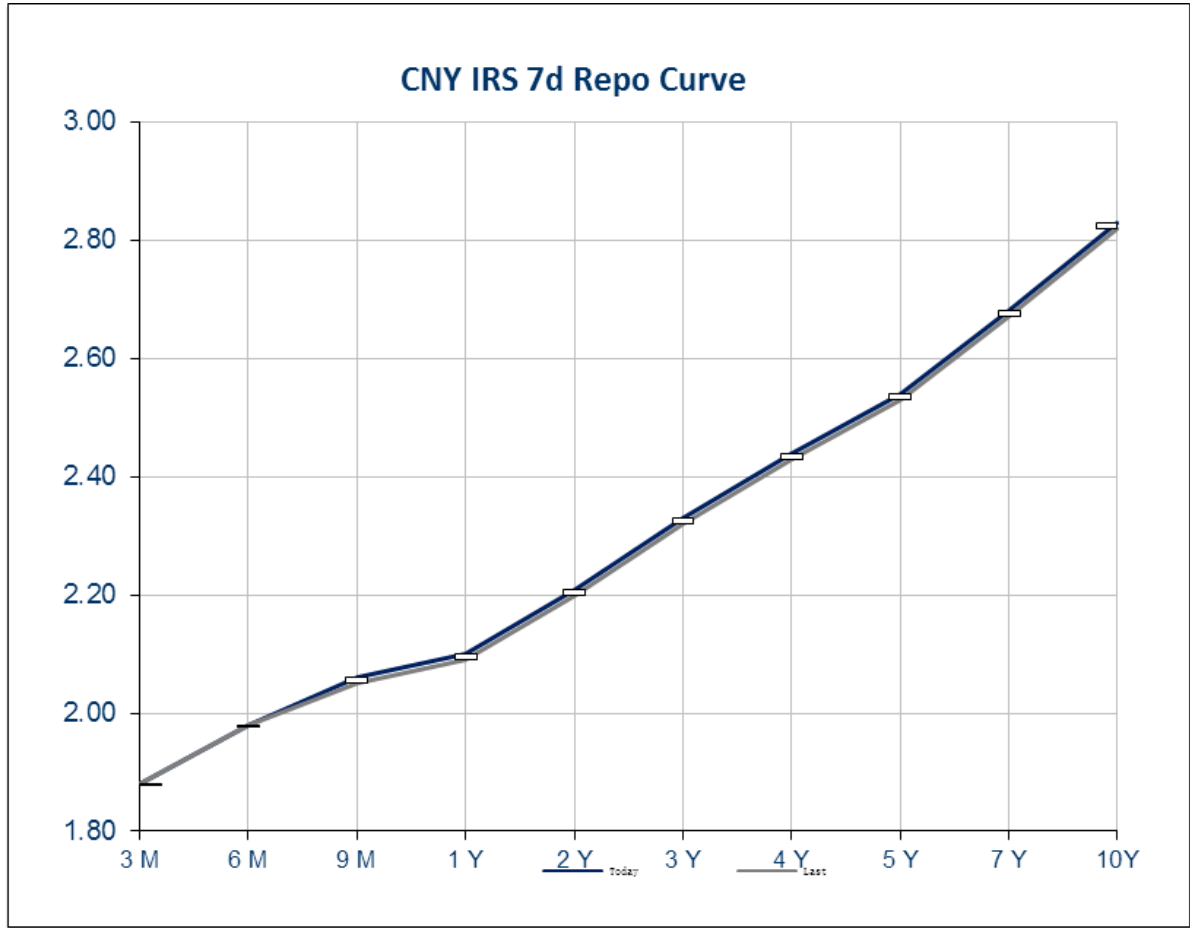
2022/6/2 Thursday

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	1.88	—				3 M	1.78	—						
6 M	1.98	—	6 M	2.16	1	6 M	1.85	—						
9 M	2.06	1	9 M	2.28	1	9 M	1.91	—						
1 Y	2.10	1	1 Y	2.36	1	1 Y	1.95	—				1Y	2.06	1
2 Y	2.21	1	2 Y	2.54	1	2 Y	2.05	—	2 Y	1.65	—	2Y	2.16	1
3 Y	2.33	1	3 Y	2.68	—	3 Y	2.06	—	3 Y	1.77	—	3Y	2.28	1
4 Y	2.44	1	4 Y	2.83	1				4 Y	1.80	—	4Y	2.38	1
5 Y	2.54	1	5 Y	2.95	1				5 Y	1.80	—	5Y	2.44	1
7 Y	2.68	1	7 Y	3.1	1				7 Y	1.80	—			
10Y	2.83	1	10Y	3.27	1				10Y	1.80	—			
7D REPO	1.65	1.00	3M Shibor	1.999	0.10	0-N Shibor	1.432	1.90	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
					Tenor	Mid	Δ bp
3M*6M	10	—					
6M*9M	8	1	12	—			
9M*1Y	4	—	8	—	6M	18	1
1*2Y	11	—	18	—	9M	22	—
1*3Y	23	—	32	-1	1Y	26	—
1*4Y	34	—	47	—	2Y	33	—
1*5Y	44	—	59	—	3Y	35	-1
2*3Y	12	—	14	-1	4Y	39	—
2*4Y	23	—	29	—	5Y	41	—
2*5Y	33	—	41	—			
3*4Y	11	—	15	1			
3*5Y	21	—	27	1			
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	0	30	54	45
今日	1	29	54	45



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