



【2022-05-24】

今日央行开展 100 亿元 7d 逆回购操作，因今日有 100 亿 7d 逆回购到期，当日资金零投放零回笼。资金面整体较均衡。7d repo fixing: 1.64%，与上一交易日增加 04bp，3m shibor fixing: 2.0130%，与上一交易日减少 0.8bp。

Repo 端，5y repo 早间成交在 2.5025%-2.4975%，后下行 gvn 在 2.495%后反弹上行 tkn 在 2.505%位置成交。午后 5y repo 成交在 2.5075%-2.5125%，后上行 tkn 在 2.515%-2.5175%成交。1y repo 成交在 2.05%-2.06%%，后上行成交在 2.07%-2.075%。盘中 6m repo trd 1.945-1.9575%；2y repo 成交在 2.17%-2.1775%；3y repo trd 2.2975%。曲线方面，6mx1y repo spd 成交在 10.5bp；9mx1y repo spd trd 4bp；2x3y repo spd 成交在 12bp；1x5y repo spd 成交在 45-44bp 附近，报收 44.25/43.75。

Shibor 端，5y shibor 报收 90.5/89.5。1y shibor 成交在 2.32%-2.325%。盘中 6m shibor 成交在 2.1575%；9m shibor 成交在 2.245%；2y shibor trd 2.4775%-2.485%，后上行成交在 2.4925%-2.4975%；3y shibor 成交在 2.635%。曲线方面，6x9m shibor 成交在 8.75bp，1x2y shibor trd 17.25bp；2x3y shibor spd trd 14.25bp。Basis 方面，9m basis trd 22.5bp；1y basis 成交在 25bp，报收 25.25/24.75；5y basis 报收 38.75/38。

其他方面报价，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

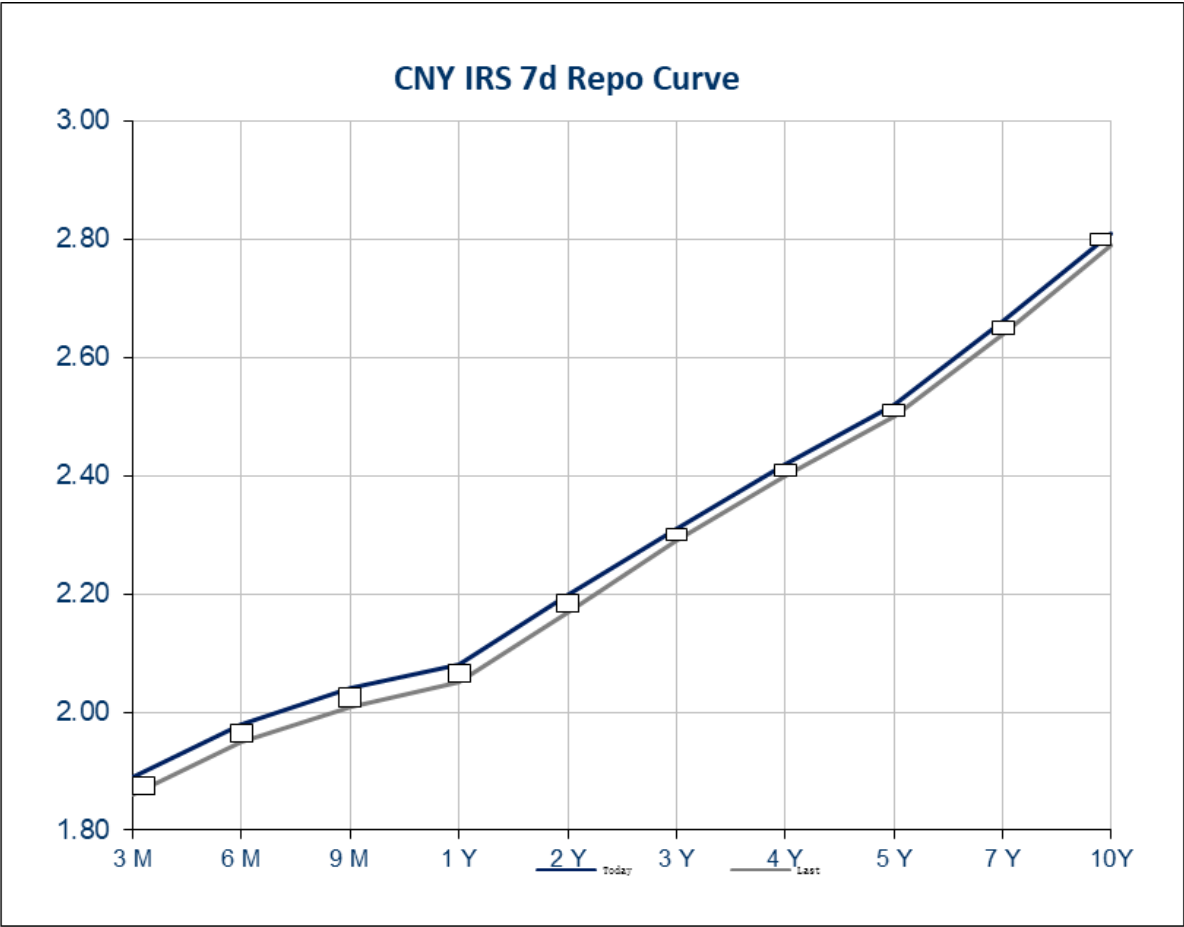
2022/5/24 Tuesday

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	1.89	3				3 M	1.78	—						
6 M	1.98	3	6 M	2.15	1	6 M	1.85	—						
9 M	2.04	3	9 M	2.24	1	9 M	1.91	—						
1 Y	2.08	3	1 Y	2.32	2	1 Y	1.95	—				1Y	2.03	2
2 Y	2.20	3	2 Y	2.50	3	2 Y	2.05	—	2 Y	1.65	—	2Y	2.14	3
3 Y	2.31	2	3 Y	2.63	1	3 Y	2.06	—	3 Y	1.77	—	3Y	2.25	2
4 Y	2.42	2	4 Y	2.78	2				4 Y	1.80	—	4Y	2.35	3
5 Y	2.52	2	5 Y	2.90	2				5 Y	1.80	—	5Y	2.41	3
7 Y	2.66	2	7 Y	3.05	2				7 Y	1.80	—			
10Y	2.81	2	10Y	3.22	2				10Y	1.80	—			
7D REPO	1.64	4.00	3M Shibor	2.013	-0.80	0-N Shibor	1.325	0.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	9	—			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	6	—	9	—			
9M*1Y	4	—	8	1	6M	17	-2
1*2Y	12	—	18	1	9M	20	-2
1*3Y	23	-1	31	-1	1Y	24	—
1*4Y	34	-1	46	—	2Y	30	—
1*5Y	44	-1	58	—	3Y	32	-1
2*3Y	11	-1	13	-2	4Y	36	—
2*4Y	22	-1	28	-1	5Y	38	—
2*5Y	32	-1	40	-1			
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	210215/5y repo	220205/5y repo
昨日	1	32	59	56
今日	0	31	58	55



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