



【2022-05-26】

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:1.87%,与上一交易日上升 05bp, 3m shibor fixing: 1.9900%,与上一交易日减少 1.9bp。

Repo 端，5y repo 率先成交在 2.4825%，后震荡成交在 2.4825%-2.47%区间，午盘报收 47.5/47，中午回来，5y repo 成交在 2.4725%-2.45% 区间附近，尾盘成交在 2.45%-2.465%区间,报收 45.75/45.5。全天 1y repo 随长端震荡成交在 2.0625%-2.0225%区间附近,尾盘海外转 pay，1y repo 成交在 0375/03.25。2y repo 成交在 2.165%-2.14%附近，4y repo 成交在 2.39%-2.36%附近，曲线方面，6mx1y 成交 08.5bp，2x5y 成交在 31.5bp 附近，4x5y 成交在 09.25bp，1x5y 成交在 43-42.25bp 附近，报收 42.5/42。

Shibor 端。1y shibor 成交在 2.2975%-2.29%附近，报收 29.75/29.25，5y shibor 成交在 2.85%-2.84%附近，报收 85/84.25，曲线方面，1x2y shibor 成交在 17bp 附近，基差方面，1y basis 报收 26/25.5。2y basis 成交在 31.25bp，5y basis 报收 39.25/38.5

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2022/5/26 Thursday

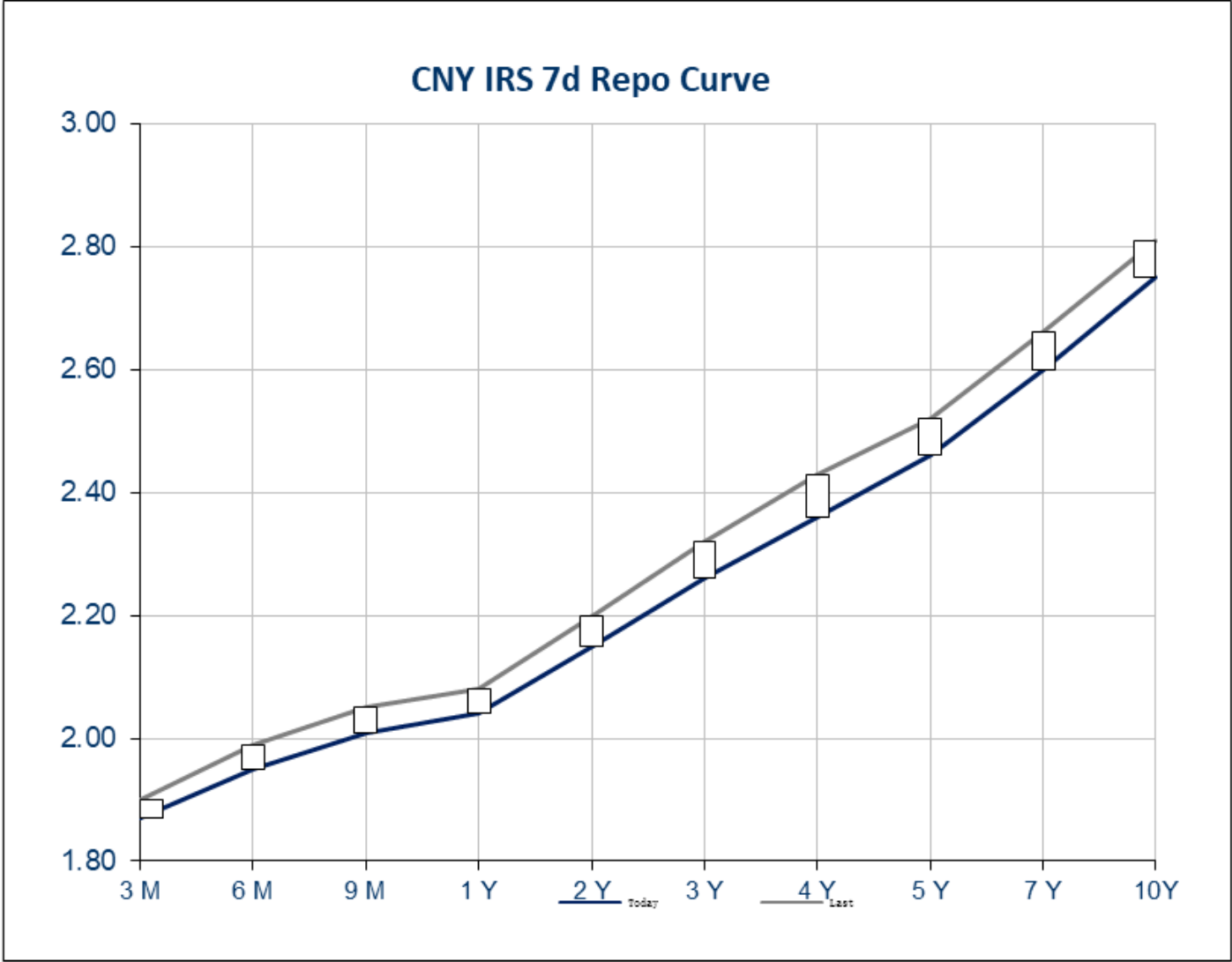
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365		
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.87	-3				3 M	1.78	-						
6 M	1.95	-4	6 M	2.13	-3	6 M	1.85	-						
9 M	2.01	-4	9 M	2.23	-2	9 M	1.91	-						
1 Y	2.04	-4	1 Y	2.30	-3	1 Y	1.95	-				1Y	1.98	-6
2 Y	2.15	-5	2 Y	2.47	-4	2 Y	2.05	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.07	-8
3 Y	2.26	-6	3 Y	2.59	-5	3 Y	2.06	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.17	-9
4 Y	2.36	-7	4 Y	2.73	-5				4 Y	1.80	-	4Y	2.26	-9
5 Y	2.46	-6	5 Y	2.85	-5				5 Y	1.80	-	5Y	2.31	-10
7 Y	2.60	-6	7 Y	3	-5				7 Y	1.80	-			
10Y	2.75	-6	10Y	3.17	-5				10Y	1.80	-			
7D REPO	1.87	5.00	3M Shibor	1.99	-1.90	0-N Shibor	1.364	1.70	1Y DEPO	1.50				

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	8	-1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	6	-	10	1			
9M*1Y	3	-	7	-1	6M	18	1
1*2Y	11	-1	17	-1	9M	22	2
1*3Y	22	-2	29	-2	1Y	26	-
1*4Y	32	-3	43	-2	2Y	32	1
1*5Y	42	-2	55	-2	3Y	33	1
2*3Y	11	-1	12	-1	4Y	37	2
2*4Y	21	-2	26	-1	5Y	39	1
2*5Y	31	-1	38	-1			
3*4Y	10	-1	14	-			
3*5Y	20	-	26	-			
4*5Y	10	1	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	-1	29	54	46
今日	2	32	57	47



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:
以上所述及列出的所有信息 (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、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, 且可未经通知而进行修改, 所有陈述和保证均明确供免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN