



【2022-05-23】

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，当日零投放零回笼。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing:1.6%,与上一交易日减少 05bp, 3m shibor fixing: 2.021%,与上一交易日减少 2.9bp。

Repo 端，5y repo 率先成交在 2.5125%，后震荡下行成交在 2.5125%-2.505%区间，午盘报收 50.75/50.5，中午回来，5y repo 下行成交在 2.5075%-2.5%区间,报收 50.25/50。全天 1y repo 随长端震荡成交在 2.0625%-2.045%区间附近,报收 05/04.5。6m repo 成交在 1.965%-1.95%，9m repo 成交在 2.02%-2.015%，2y repo 成交在 2.175%-2.17%附近。曲线方面，1x5y 成交在 45bp 附近，报收 45/44.75，6mx1y 成交在 10.25bp。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.31%-2.2975%附近，报收 30.25/30，2y shibor 成交在 2.475%，3y shibor 成交在 2.625%-2.6225%附近。基差方面，1y basis 成交 25.25bp，报收 25.25/25；5y basis 报收 38.5/37.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

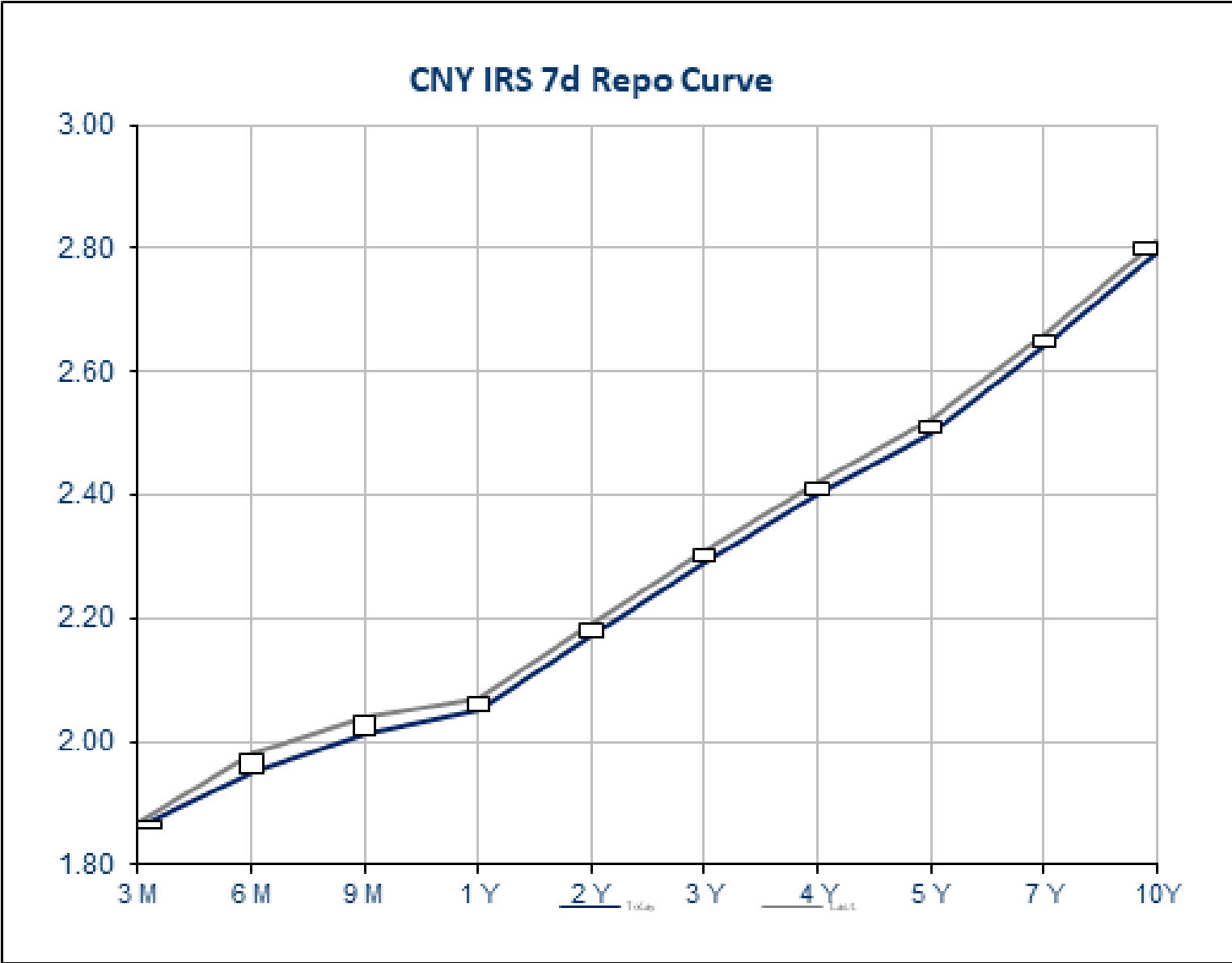
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2022/5/23 Monday

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	1.95	-3	6 M	2.14	-4	6 M	1.85	-						
9 M	2.01	-3	9 M	2.23	-3	9 M	1.91	-						
1 Y	2.05	-2	1 Y	2.30	-3	1 Y	1.95	-				1Y	2.01	-2
2 Y	2.17	-2	2 Y	2.47	-2	2 Y	2.05	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.11	-2
3 Y	2.29	-2	3 Y	2.62	-2	3 Y	2.06	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.23	-1
4 Y	2.40	-2	4 Y	2.76	-2				4 Y	1.80	-	4Y	2.32	-2
5 Y	2.50	-2	5 Y	2.88	-3				5 Y	1.80	-	5Y	2.38	-3
7 Y	2.64	-2	7 Y	3.03	-3				7 Y	1.80	-			
10Y	2.79	-2	10Y	3.20	-3				10Y	1.80	-			
7D REPO	1.60	-5.00	3M Shibor	2.021	-2.90	O-N Shibor	1.323	0.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	9	-2			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	6	-	9	1			
9M*1Y	4	1	7	-	6M	19	-1
1*2Y	12	-	17	1	9M	22	-
1*3Y	24	-	32	1	1Y	25	-
1*4Y	35	-	46	1	2Y	30	-
1*5Y	45	-	58	-	3Y	33	-
2*3Y	12	-	15	-	4Y	36	-
2*4Y	23	-	29	-	5Y	38	-1
2*5Y	33	-	41	-1			
3*4Y	11	-	14	-			
3*5Y	21	-	26	-1			
4*5Y	10	-	12	-1			
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	55
今日	1	32	59	56



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