



【2022-05-31】

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: 1.86%，与上一交易日增加 01bp；3m shibor fixing: 1.9980%，与上一交易日增加 0.1bp。数据方面，中国 5 月官方制造业 PMI 前值 47.4 预期 48.9 公布 49.6；中国 5 月非制造业 PMI 前值 41.9 预期 45 公布 47.8。

Repo 端，5y repo 早间成交在 2.4975%-2.50%。后受数据影响，5y repo tkn 在 2.515% 后继续上行 tkn 在 2.5225%-2.525%区间成交。午后 5y repo 成交在 2.5275%-2.53%，后回落 gvn 在 2.525%位置成交。1y repo 成交在 2.085%-2.09%，后上行成交在 2.09%-2.095%。盘中 6m repo 成交在 1.9875%；3y repo trd 2.3225%。曲线方面，6mx1y repo spd trd 10-10.5bp；3x5y repo spd 成交在 20bp；1x5y repo spd 成交在 43-43.75bp。

Shibor 端今日成交清淡，5y shibor 成交在 2.93%-2.935%。1y shibor 成交在 34.75%-34.25%。Basis 方面，1y basis 成交在 25.5bp；5y basis 成交在 40.75bp。

其他方面报价，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2022/5/31 Tuesday

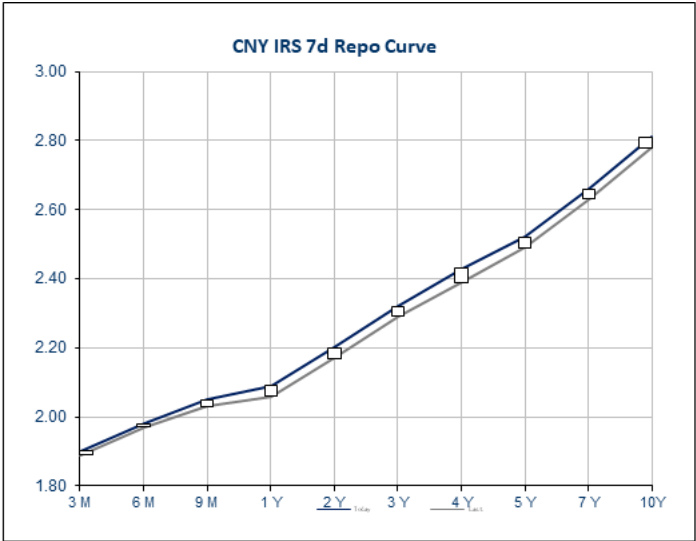
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365 (F) A/360 (F)			A/365		
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.90	1				3 M	1.78	–						
6 M	1.98	1	6 M	2.16	1	6 M	1.85	–						
9 M	2.05	2	9 M	2.27	2	9 M	1.91	–						
1 Y	2.09	3	1 Y	2.35	3	1 Y	1.95	–				1Y	2.05	4
2 Y	2.20	3	2 Y	2.53	3	2 Y	2.05	–	2 Y	1.65	–	2Y	2.14	3
3 Y	2.32	3	3 Y	2.66	4	3 Y	2.06	–	3 Y	1.77	–	3Y	2.25	4
4 Y	2.43	4	4 Y	2.81	4				4 Y	1.80	–	4Y	2.35	5
5 Y	2.52	3	5 Y	2.93	4				5 Y	1.80	–	5Y	2.41	5
7 Y	2.66	3	7 Y	3.08	4				7 Y	1.80	–			
10Y	2.81	3	10Y	3.25	4				10Y	1.80	–			
7D REPO	1.86	1.00	3M Shibor	1.998	0.10	N 0-Shibor	1.588	18.30	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	–			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	7	1	11	1			
9M*1Y	4	1	8	1	6M	18	–
1*2Y	11	–	18	–	9M	22	–
1*3Y	23	–	31	1	1Y	26	–
1*4Y	34	1	46	1	2Y	33	–
1*5Y	43	–	58	1	3Y	34	1
2*3Y	12	–	13	1	4Y	38	–
2*4Y	23	1	28	1	5Y	41	1
2*5Y	32	–	40	1			
3*4Y	11	1	15	–			
3*5Y	20	–	27	–			
4*5Y	9	-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	-2	29	57	46
今日	1	30	55	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报及更多资讯



免责声明:
以上所登及附加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的私/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、及时性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN