

收盘日评 银行间利率衍生品市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-05-10】

中国人民银行今日进行 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。今日无逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.87%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 1.9890%，与上一交易日下降-0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.135%附近，后稍微震荡上行，成交在 2.1325%-2.1525%区间附近，午盘报收 15/14.75。中午回来，5y repo 稍微震荡上行，成交到 2.1625%位置，后震荡下行，成交在 2.16%-2.145%区间附近，报收 14.75/14.5。1y repo 全天震荡成交在 1.9375%-1.925%区间附近，尾盘报收 92.75/92.5。其他期限，9m repo 成交在 1.9375%附近，2y repo 成交在 1.94%附近，4y repo 成交在 2.085%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-0.5~-0.25bp 附近，4x5y repo 成交在 6.75bp 附近，1x5y repo 成交在 21-22.25bp 附近，曲线走陡，报收 22/21.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 01/00.5，5y shibor 报收 26.75/26.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 26/25.25。基差方面，1y basis 报收 8.5/8，5y basis 报收 12/11.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

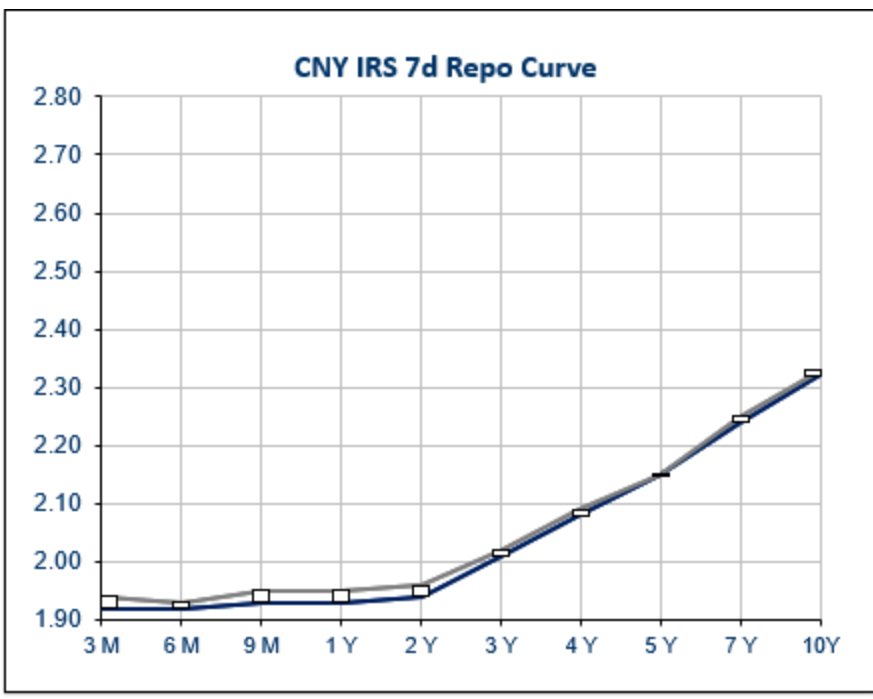
2024/5/10 Friday

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	1.92	-2				3 M	1.7	-5						
6 M	1.92	-1	6 M	1.99	-1	6 M	1.7	-						
9 M	1.93	-2	9 M	2.01	-2	9 M	1.7	-5						
1 Y	1.93	-2	1 Y	2.01	-2	1 Y	1.7	2				1Y	1.93	-1
2 Y	1.94	-2	2 Y	2.03	-2	2 Y	1.7	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-1
3 Y	2.01	-1	3 Y	2.1	-2	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.99	-1
4 Y	2.08	-1	4 Y	2.19	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.05	-1
5 Y	2.15	-	5 Y	2.27	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.13	-
7 Y	2.24	-1	7 Y	2.37	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.32	-1	10Y	2.44	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.87	-3.00	3M Shibor	1.989	-0.20	0-N Shibor	1.733	0.60	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO
			Tenor	Mid Δ bp
3M*6M	0 1			
6M*9M	1 -1	2 -1		
9M*1Y	0 -	0 -	6M	7 -
1*2Y	1 -	2 -	9M	8 -
1*3Y	8 1	9 -	1Y	8 -
1*4Y	15 1	18 2	2Y	9 -
1*5Y	22 2	26 2	3Y	9 -1
2*3Y	7 1	7 -	4Y	11 1
2*4Y	14 1	16 2	5Y	12 -
2*5Y	21 2	24 2		
3*4Y	7 -	9 2		
3*5Y	14 1	17 2		
4*5Y	7 1	8 -		
5*7Y	9 -1	10 -		
5*10Y	17 -1	17 -		

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	45	42	39	38	37	38
今日	47	45	43	39	35	34	34

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	0	21	4	30
今日	-2	20	2	30



联系人: Ruby Ho
 邮箱: ruby@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:
 以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅以提供信息, 且为保密的、或者专用的信息, 其知识仅限于上海国联证券经纪有限公司 (以下简称“上海国联证券”) 或其三方。“信息”不能也不应被解释为任何金融工具、服务或任何交易策略相关的推介、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, 且可能随时通知而进行修改, 所有陈述和保证均按明确免责声明处理。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang