

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

【2024-05-08】

中国人民银行今日开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，因今日没有逆回购到期，当日实现净投放 20 亿元。资金面整体均衡偏宽松，7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日保持不变，3m shibor fixing: 1.9900%，与上一交易日下降 0.6 个 bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.13%附近，随后震荡下行，成交在 2.135%-2.115%区间附近，午盘报收 12/11.5。中午回来，5y repo 维持区间震荡，成交在 2.1225%-2.11%附近，报收 12.75/12.25。1y repo，震荡成交在 1.935%-1.92%区间附近，下午尾盘报 93.25/3。其他期限，3m repo 成交在 1.9175-1.93%附近，6m repo 成交在 1.92%-1.925%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在 00.75bp 附近，2x3 repo 成交在 05bp 附近，4x5y repo 成交在 06.5bp 附近，1x2x5y repo 成交在 -18.5bp 附近，1x5y repo 成交在 19-19.75bp 区间附近，报收 19.5/19。

Shibor 端，今日成交清淡，1y shibor 成交在 1.995%附近，1y shibor 报收 00.5/99.75。5y shibor 报收 23/22.25。基差方面，1y basis 成交在 07bp 附近，报收 07.5/07，5y basis 报收 11.25/10.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

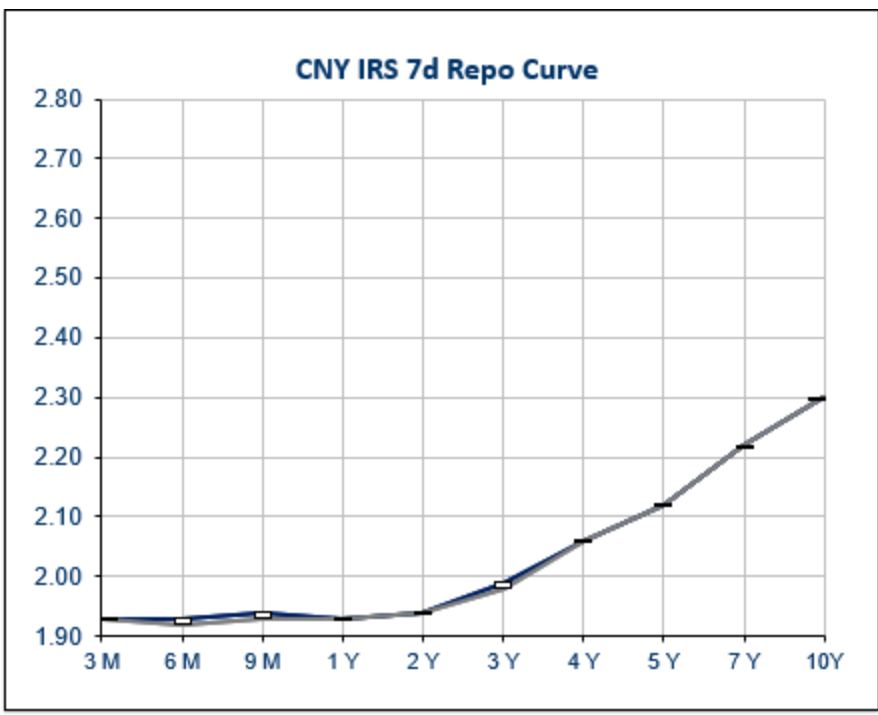
2024/5/8 Wednesday

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	1.93	-				3 M	1.75	-						
6 M	1.93	1	6 M	1.98	-	6 M	1.7	-						
9 M	1.94	1	9 M	2.01	1	9 M	1.75	-						
1 Y	1.93	-	1 Y	2	-	1 Y	1.68	-5				1Y	1.93	-
2 Y	1.94	-	2 Y	2.02	-	2 Y	1.7	-5	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	-
3 Y	1.99	1	3 Y	2.08	1	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.97	-
4 Y	2.06	-	4 Y	2.16	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.04	-
5 Y	2.12	-	5 Y	2.23	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.09	-1
7 Y	2.22	-	7 Y	2.32	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.3	-	10Y	2.4	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-	3M Shibor	1.99	-0.60	0-N Shibor	1.837	9.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO
			Tenor	Mid Δ bp
3M*6M	0 1			
6M*9M	1 -	3 1		
9M*1Y	-1 -1	-1 -1	6M	5 -1
1*2Y	1 -	2 -	9M	7 -
1*3Y	6 1	8 1	1Y	7 -
1*4Y	13 -	16 1	2Y	8 -
1*5Y	19 -	23 -	3Y	9 -
2*3Y	5 1	6 1	4Y	10 1
2*4Y	12 -	14 1	5Y	11 -
2*5Y	18 -	21 -		
3*4Y	7 -1	8 -		
3*5Y	13 -1	15 -1		
4*5Y	6 -	7 -1		
5*7Y	10 -	9 -1		
5*10Y	18 -	17 -1		

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	-2	21	2	30
今日	0	22	4	30



联系人: Ruby Hu
 邮箱: rubyhu@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:
 以上所述及附送的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供参考, 且为保密的、或者专用的信息, 其知识“仅属于上海国际货币经纪有限公司 (以下简称“上海国际货币”) 或第三方。“信息”不应被视为任何投资建议、买卖或任何交易策略相关的建议、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, 且可能未经通知而进行修改, 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