



【2024-05-30】

今日进行 2600 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。因今日有 20 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 2580 亿元，资金面均衡转宽松。7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 1.957%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.045%附近，后震荡成交在 2.0425%-2.0525%区间附近，午盘报收 04.25/04。中午回来，5y repo 小幅震荡后尾盘拉升，成交在 2.0325%-2.05%附近，报收 04.75/04.25。1y repo 全天震荡成交在 1.84%-1.8575%区间附近，尾盘报收 84.75/84.5。其他期限，6m repo 成交在 1.85%附近，9m repo 成交在 1.8475%-1.86%区间附近，4y repo 成交在 1.975%附近。曲线方面，6x9m repo 成交在 0.5bp 附近，1x5y repo 成交在 19.5bp 点位，报收 20/19.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 96.75/95.5，5y shibor 报收 17.25/16.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 21.75/19.75。基差方面，1y basis 报收 12/11，5y basis 报收 13/12。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

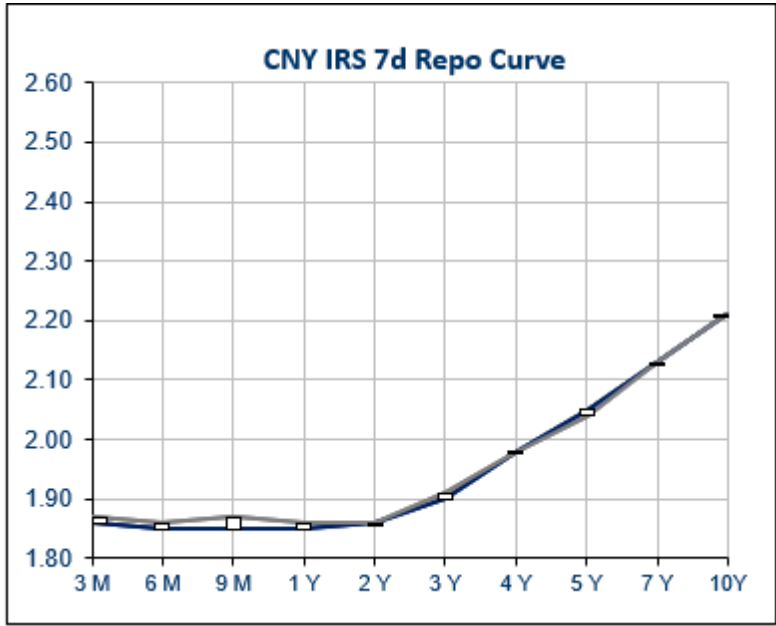
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/5/30 Thursday

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	1.86	-1				3 M	1.75	5						
6 M	1.85	-1	6 M	1.94	-2	6 M	1.7	-						
9 M	1.85	-2	9 M	1.98	-1	9 M	1.75	5						
1 Y	1.85	-1	1 Y	1.96	-2	1 Y	1.75	5				1Y	1.85	-1
2 Y	1.86	-	2 Y	1.97	-2	2 Y	1.75	5	2 Y	1.65	-	2Y	1.85	-
3 Y	1.9	-1	3 Y	2.03	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.89	-
4 Y	1.98	-	4 Y	2.1	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.95	-
5 Y	2.05	1	5 Y	2.17	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.01	-
7 Y	2.13	-	7 Y	2.28	1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.21	-	10Y	2.36	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.95	-3.00	3M Shibor	1.957	-	0-N Shibor	1.746	-10.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-1	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	-1	4	1				
9M*1Y	0	1	-2	-1	6M	9	-1	
1*2Y	1	1	1	-	9M	13	1	
1*3Y	5	-	7	2	1Y	11	-1	
1*4Y	13	1	14	3	2Y	11	-2	
1*5Y	20	2	21	2	3Y	13	1	
2*3Y	4	-1	6	2	4Y	12	1	
2*4Y	12	-	13	3	5Y	12	-1	
2*5Y	19	1	20	2				
3*4Y	8	1	7	1				
3*5Y	15	2	14	-				
4*5Y	7	1	7	-1				
5*7Y	8	-1	11	1				
5*10Y	16	-1	19	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	43	41	37	36	35	35
今日	46	43	42	37	36	35	35

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	4	28	9	38
今日	4	28	8	38



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting.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:

以上所发及所加的所有信息 (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推介、定价、建议或诱导。“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, 所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang