



【2024-05-13】

中国央行今日进行 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。因今日有 20 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现零投放零回笼。资金面整体偏松。7d repo fixing：1.88%，与上一交易日上升 3bp，3m shibor fixing: 1.9830%，与上一交易日下降-0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.145%附近，后稍微震荡下行，成交在 2.105%-2.145%区间附近，午盘报收 11.25/11。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 2.085%-2.1175%区间附近，报收 09/08.75。1y repo 全天震荡成交在 1.875%-1.905%区间附近，尾盘报收 87.5/87.25。其他期限，6m repo 成交在 1.86%附近，9m repo 成交在 1.875%-1.88%区间附近，2y repo 成交在 1.8875%-1.90%区间附近。曲线方面，6x9m repo 成交在 01.5bp 点位，9mx1y repo 成交在 -00.25bp 点位，1x5y repo 成交在 21.25-22.75bp 区间附近，报收 21.75/21.5，2x5y repo 成交在 21.5bp 点位。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 97.75/97.25，5y shibor 报收 20.5/20。曲线方面，1x5y shibor 报收 22.75/22.5。基差方面，1y basis 报收 10.5/9.75，5y basis 报收 11.5/11。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

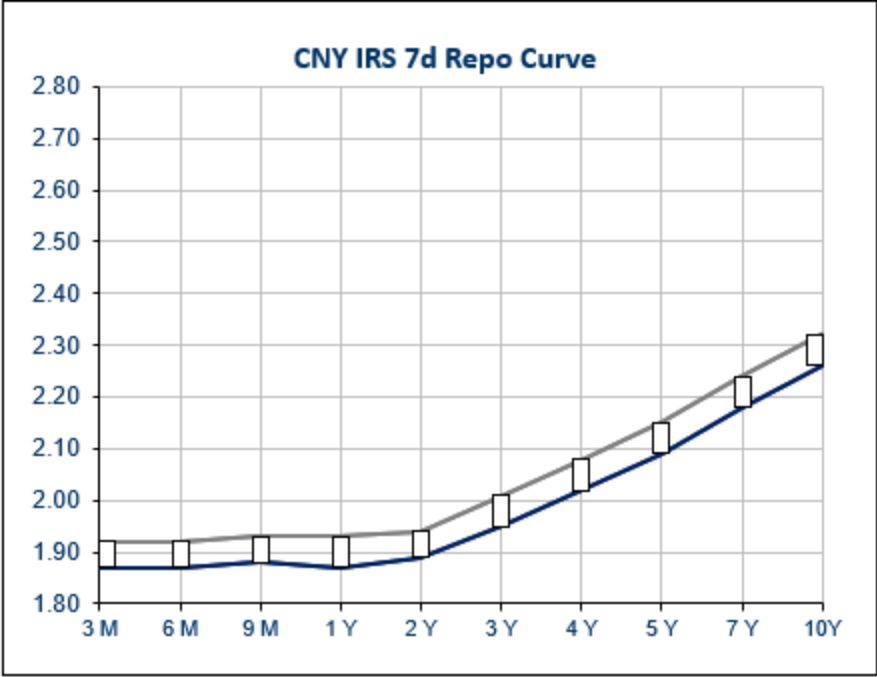
2024/5/13 Monday

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	1.87	-5				3 M	1.68	-2						
6 M	1.87	-5	6 M	1.96	-3	6 M	1.66	-4						
9 M	1.88	-5	9 M	1.98	-3	9 M	1.75	5						
1 Y	1.87	-6	1 Y	1.97	-4	1 Y	1.65	-5				1Y	1.87	-6
2 Y	1.89	-5	2 Y	1.99	-4	2 Y	1.75	5	2 Y	1.65	-	2Y	1.87	-7
3 Y	1.95	-6	3 Y	2.05	-5	3 Y	1.8	-5	3 Y	1.77	-	3Y	1.92	-7
4 Y	2.02	-6	4 Y	2.13	-6				4 Y	1.8	-	4Y	1.98	-7
5 Y	2.09	-6	5 Y	2.2	-7				5 Y	1.8	-	5Y	2.06	-7
7 Y	2.18	-6	7 Y	2.3	-7				7 Y	1.8	-			
10Y	2.26	-6	10Y	2.38	-6				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.88	3.00	3M Shibor	1.983	-0.50	0-N Shibor	1.781	5.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0	-		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	-	2	-			
9M*1Y	-1	-1	-1	-1	6M	9	2
1*2Y	2	1	2	-	9M	10	2
1*3Y	8	-	8	-1	1Y	10	2
1*4Y	15	-	16	-2	2Y	10	1
1*5Y	22	-	23	-3	3Y	10	1
2*3Y	6	-1	6	-1	4Y	11	-
2*4Y	13	-1	14	-2	5Y	11	-1
2*5Y	20	-1	21	-3			
3*4Y	7	-	8	-1			
3*5Y	14	-	15	-2			
4*5Y	7	-	7	-1			
5*7Y	9	-	10	-			
5*10Y	17	-	18	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	20	2	30
今日	1	24	5	34



联系人: Ruby Hu
邮箱: viacding.hu@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”) 仅供以提供信息, 且为保密的利/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限公司 (以下简称“上海国脉货币”) 或其三方。“信息”不应也不应被解释为与任何金融工具、投资策略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, 且可未经通知而进行修改, 所有前述和保证均按协议条款声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang