



【2024-05-09】

 中国央行今日开展 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: 1.9910%，与上一交易日上升 0.1 个 bp。

 数据方面，4 月当月，进出口 3.64 万亿元，增长 8%。其中，出口 2.08 万亿元，增长 5.1%；进口 1.56 万亿元，增长 12.2%。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.13%附近，随后震荡成交在 2.1225%-2.135%区间附近，午盘报收 13.5/13。中午回来，5y repo 上行成交在 2.13%-2.1575%附近，报收 15.75/15.5。1y repo 随长端震荡成交在 1.9275%-1.95%区间附近，尾盘报 95.25/94.75。其他期限，6m repo 成交在 1.9275%附近。2y repo 成交在 2.95%-2.9575%附近，3y repo 成交在 2.015%附近。曲线方面，1x2y repo 成交在 01.25bp 附近，1x3y repo 成交在 06.75bp 附近。4x5y repo 成交在 06.5bp 附近，1x5y repo 成交在 19.5-20.25bp 区间附近，报收 20.75/20.25。

 Shibor 端，今日成交清淡，1y shibor 报收 03.5/02。5y shibor 报收 27.5/26.75。基差方面，1y basis 报收 08.5/07.5，5y basis 报收 12/11.5。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

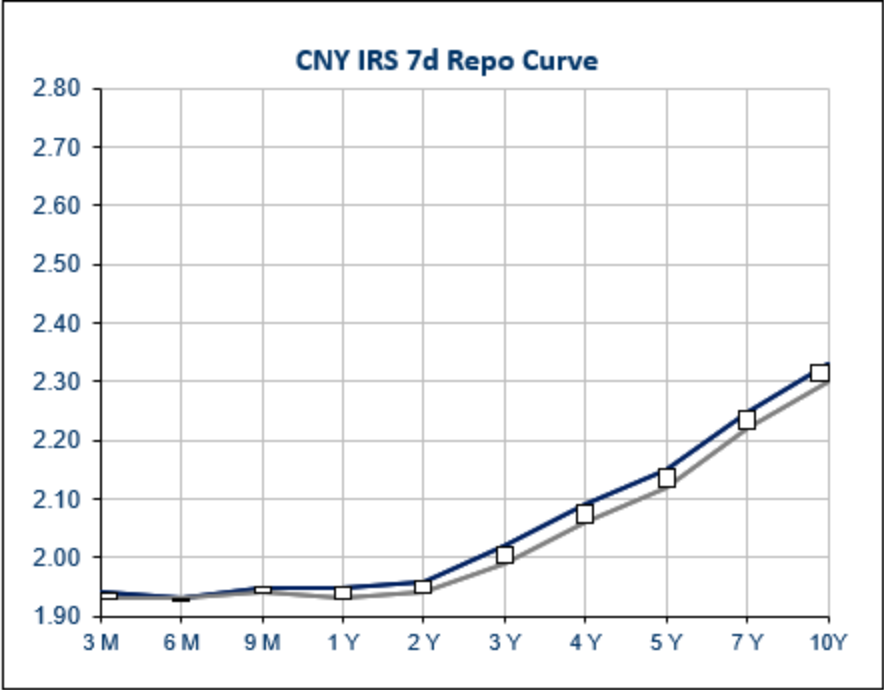
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/5/9 Thursday

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	1.94	1				3 M	1.75	–									
6 M	1.93	–	6 M	2	2	6 M	1.7	–									
9 M	1.95	1	9 M	2.03	2	9 M	1.75	–									
1 Y	1.95	2	1 Y	2.03	3	1 Y	1.68	–				1Y	1.94	1			
2 Y	1.96	2	2 Y	2.05	3	2 Y	1.7	–	2 Y	1.65	–	2Y	1.95	2			
3 Y	2.02	3	3 Y	2.12	4	3 Y	1.85	–	3 Y	1.77	–	3Y	2	3			
4 Y	2.09	3	4 Y	2.19	3				4 Y	1.8	–	4Y	2.06	2			
5 Y	2.15	3	5 Y	2.27	4				5 Y	1.8	–	5Y	2.13	4			
7 Y	2.25	3	7 Y	2.37	5				7 Y	1.8	–						
10Y	2.33	3	10Y	2.44	4				10Y	1.8	–						
7D REPO	1.90	–	3M Shibor	1.991	0.10	0-N Shibor	1.727	-11.00	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	–1	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	2	1	3	–				
9M*1Y	0	1	0	1	6M	7	2	
1*2Y	1	–	2	–	9M	8	1	
1*3Y	7	1	9	1	1Y	8	1	
1*4Y	14	1	16	–	2Y	9	1	
1*5Y	20	1	24	1	3Y	10	1	
2*3Y	6	1	7	1	4Y	10	–	
2*4Y	13	1	14	–	5Y	12	1	
2*5Y	19	1	22	1				
3*4Y	7	–	7	-1				
3*5Y	13	–	15	–				
4*5Y	6	–	8	1				
5*7Y	10	–	10	1				
5*10Y	18	–	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	22	4	30
今日	0	21	4	30



联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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”) 仅用以提供信息, 并非投资建议, 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”) 或其三方。“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、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、及时性或及时性等要求, 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

文 / Joyce Zhang