



【2024-05-07】

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。因今日有 4400 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 4380 亿元。资金面整体偏松。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing:1.9960%，与上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.1375%附近，后震荡成交在 2.1275%-2.1375%区间附近，午盘报收 12.75/12.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.1225%-2.135%区间附近，报收 12.25/12。1y repo，震荡成交在 1.9275%-1.9375%区间附近，尾盘报收 93/92.5。其他期限，9m 成交在 1.93%-1.9375%区间附近，2y repo 成交在 1.935%-1.945%区间附近，3y repo 成交在 1.9975%。曲线方面，1x5y repo 成交在 19.25-20bp 区间附近，报收 19.5/19，9mx1y repo 成交在 -0.25~-0.5bp 区间附近，1x2y repo 成交在 0.75bp 点位，4x5y repo 成交在 6.25bp 点位。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.0025%2.0075%区间附近，报收 00.5/00。2y shibor 成交在 2.03%，5y shibor 成交在 2.225%，报收 23/22.5。基差方面，1y basis 成交在 7.75bp 点位，报收 7.75/7.25，5y basis 成交在 10bp 点位，报收 10.5/9.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

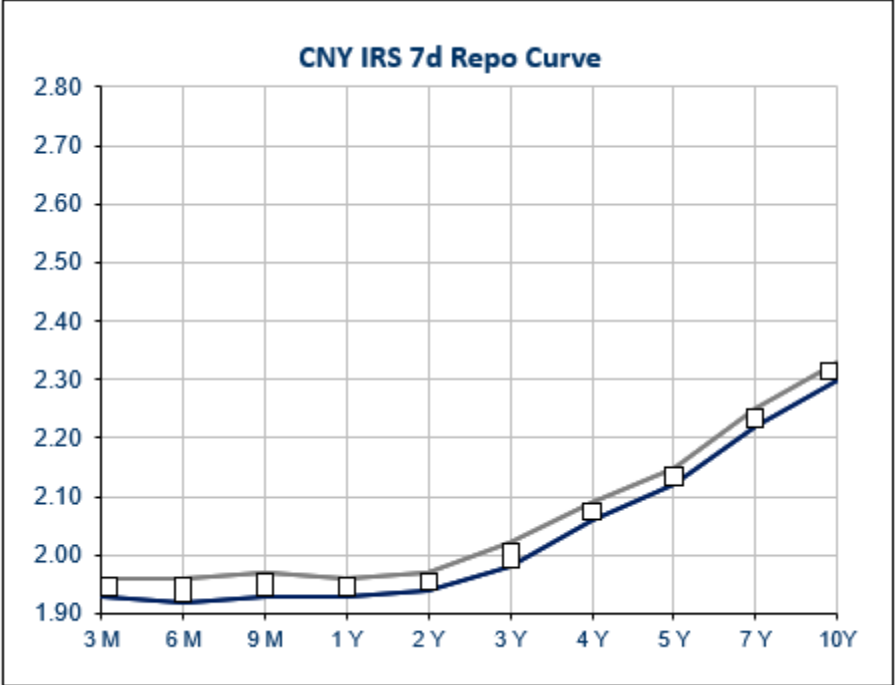
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/5/7 Tuesday

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				3 M	1.75	-						
6 M	1.92	-4	6 M	1.98	-3	6 M	1.7	-						
9 M	1.93	-4	9 M	2	-4	9 M	1.75	-						
1 Y	1.93	-3	1 Y	2	-4	1 Y	1.73	5				1Y	1.93	-3
2 Y	1.94	-3	2 Y	2.02	-5	2 Y	1.75	5	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	-4
3 Y	1.98	-4	3 Y	2.07	-7	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.97	-4
4 Y	2.06	-3	4 Y	2.15	-6				4 Y	1.8	-	4Y	2.04	-4
5 Y	2.12	-3	5 Y	2.23	-6				5 Y	1.8	-	5Y	2.1	-4
7 Y	2.22	-3	7 Y	2.33	-7				7 Y	1.8	-			
10Y	2.3	-3	10Y	2.41	-5				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-5.00	3M Shibor	1.996	-0.50	0-N Shibor	1.744	-3.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-1	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	-	2	-1				
9M*1Y	0	1	0	-	6M	6	1	
1*2Y	1	-	2	-1	9M	7	-	
1*3Y	5	-1	7	-3	1Y	7	-1	
1*4Y	13	-	15	-2	2Y	8	-2	
1*5Y	19	-	23	-2	3Y	9	-3	
2*3Y	4	-1	5	-2	4Y	9	-3	
2*4Y	12	-	13	-1	5Y	11	-3	
2*5Y	18	-	21	-1				
3*4Y	8	1	8	1				
3*5Y	14	1	16	1				
4*5Y	6	-	8	-				
5*7Y	10	-	10	-1				
5*10Y	18	-	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	-3	20	0	29
今日	-2	21	2	30



联系人: Ruby Wu
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”) 仅用以提供信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识产仅属于上海国际货币经纪有限责任公司 (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、投资策略或任何交易策略相关的报价、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, 所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN