



【2024-05-29】

今日进行 2500 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 2480 亿元，资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.98%，与上一交易日上升 3bp，3m shibor fixing: 1.957%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.035%附近，后震荡成交在 2.0265%-2.04%区间附近，午盘报收 04/03.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.0375%-2.0425%附近，报收 04.5/04.25。1y repo 全天震荡成交在 1.85%-1.8575%区间附近，尾盘报收 86/85.75。其他期限，6m repo 成交在 1.86%附近，2y repo 成交在 1.8625%-1.865%区间附近，3y repo 成交在 1.905%-1.9075%区间附近，4y repo 成交在 1.9725%-1.9775%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在 0.75bp 点位，4x5y repo 成交在 6.5bp 点位，3x4x5y repo 成交在 0.5bp 点位，1x5y repo 成交在 18.25bp 点位，报收 18.75/18.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 98.25/97.75，5y shibor 报收 17.25/16.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 19.5/18.75。基差方面，1y basis 报收 12.5/11.75，5y basis 报收 13/12.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

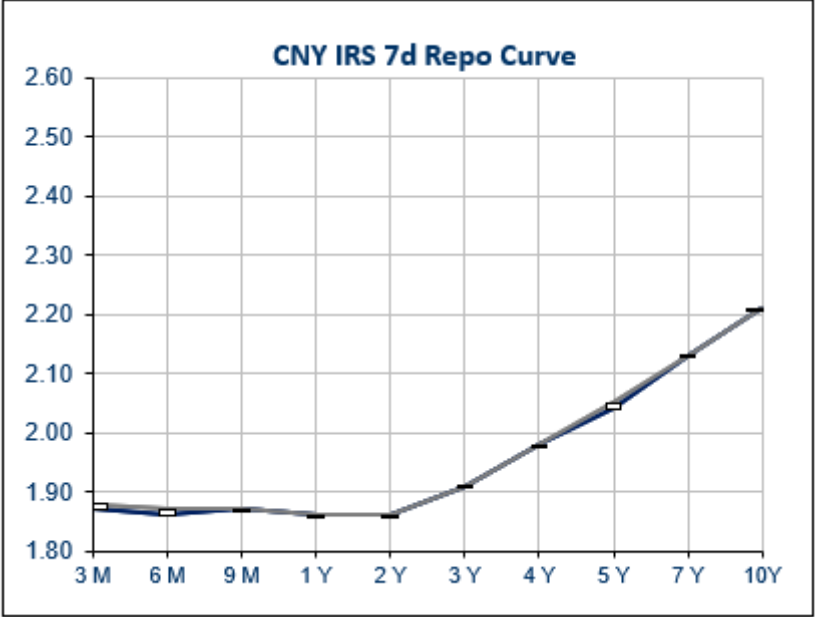
2024/5/29 Wednesday

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	1.87	-1				3 M	1.7	2						
6 M	1.86	-1	6 M	1.96	1	6 M	1.7	4						
9 M	1.87	-	9 M	1.99	-	9 M	1.7	4						
1 Y	1.86	-	1 Y	1.98	-1	1 Y	1.7	7				1Y	1.86	-
2 Y	1.86	-	2 Y	1.99	-	2 Y	1.7	4	2 Y	1.65	-	2Y	1.85	-
3 Y	1.91	-	3 Y	2.03	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.89	-
4 Y	1.98	-	4 Y	2.09	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.95	-
5 Y	2.04	-1	5 Y	2.17	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.01	-
7 Y	2.13	-	7 Y	2.27	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.21	-	10Y	2.35	-2				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.98	3.00	3M Shibor	1.957	-	0-N Shibor	1.849	3.90	1Y DEPO	1.50				

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

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	3	27	8	38
今日	4	28	9	38



联系人: Ruby Hu
邮箱: ruby.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、股票或任何交易策略相关的报价、定价、建议或推荐。“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。且可未经通知的进行修改, 所有前述和保证均按协议条款声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang