



【2024-05-06】

中国人民银行今日进行 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。今日有 100 亿元逆回购到期。资金面整体偏松。7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日下降 15bp，3m shibor fixing: 2.0010%，与上一交易日下降-0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.1625%附近，随后震荡成交在 2.17%-2.1625%区间附近，后国债期货震荡拉升，5y repo 下行成交在 2.165%-2.1525%附近，午盘报收 15.75/15.25。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.16%-2.15%区间附近，报收 15.25/14.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.96%-1.98%区间附近，尾盘报收 96.25/95.75。其他期限，9m repo 成交在 1.98%附近，2y repo 成交在 1.97%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-1bp 附近，1x2y repo 成交在 0.75bp 附近，1x5y repo 成交在 19.5-19.25bp 附近，报收 19.5/19。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 成交在 2.045%附近，报收 4.5/4.25，5y shibor 报收 29.75/29.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 25.5/25。基差方面，1y basis 成交在 8.5bp 附近，报收 8.5/8，5y basis 报收 14.5/14。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

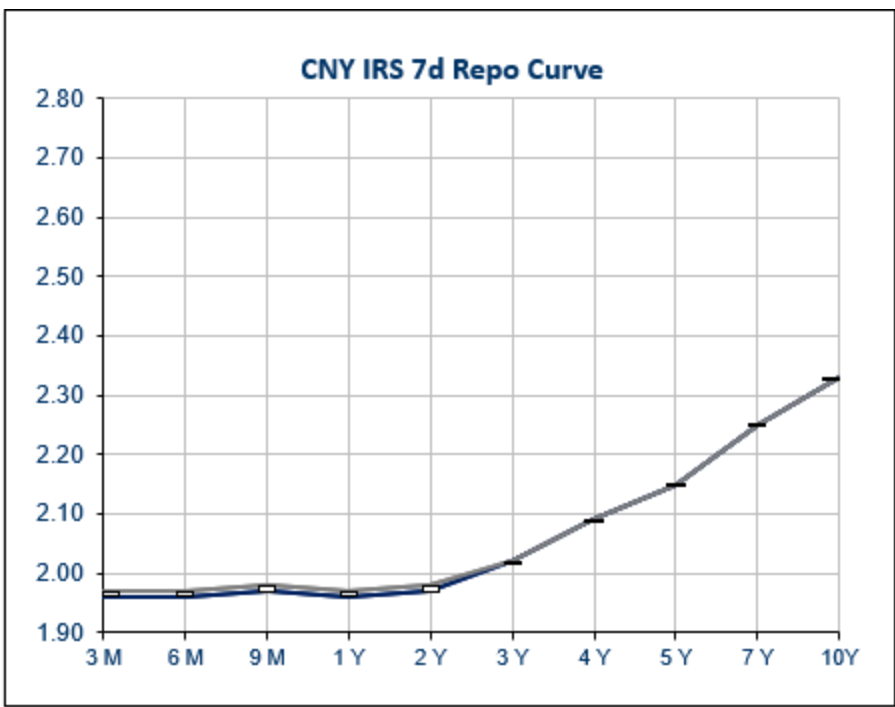
2024/5/6 Monday

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	1.96	-1				3 M	1.75	-							
6 M	1.96	-1	6 M	2.01	-1	6 M	1.7	-5							
9 M	1.97	-1	9 M	2.04	-2	9 M	1.75	-							
1 Y	1.96	-1	1 Y	2.04	-3	1 Y	1.68	-2				1Y	1.96	-2	
2 Y	1.97	-1	2 Y	2.07	-2	2 Y	1.7	-3	2 Y	1.65	-	2Y	1.97	-1	
3 Y	2.02	-	3 Y	2.14	-2	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.01	-1	
4 Y	2.09	-	4 Y	2.21	-2				4 Y	1.8	-	4Y	2.08	-1	
5 Y	2.15	-	5 Y	2.29	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.14	-	
7 Y	2.25	-	7 Y	2.4	-				7 Y	1.8	-				
10Y	2.33	-	10Y	2.46	-				10Y	1.8	-				
7D REPO	1.95	-15.00	3M Shibor	2.001	-0.10	0-N Shibor	1.777	-14.40	1Y DEPO	1.50					

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
			Tenor	Mid	Δ bp	
3M*6M	0	-				
6M*9M	1	-	3	-1		
9M*1Y	-1	-	0	-1	6M	5
1*2Y	1	-	3	1	9M	7
1*3Y	6	1	10	1	1Y	8
1*4Y	13	1	17	1	2Y	10
1*5Y	19	1	25	2	3Y	12
2*3Y	5	1	7	-	4Y	12
2*4Y	12	1	14	-	5Y	14
2*5Y	18	1	22	1		
3*4Y	7	-	7	-		
3*5Y	13	-	15	1		
4*5Y	6	-	8	1		
5*7Y	10	-	11	1		
5*10Y	18	-	17	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	0	20	3	30
今日	-3	20	0	29



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:
 以上所发及所包含的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供参考, 不作为投资建议, 其知识仅限于上海国际证券经纪有限公司 (以下简称“上海国际证券”) 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推介、定价、建议或诱导。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其所提供、及时性或准确性等要求, 且可能随时进行修订, 所有陈述和保证均按原文发布。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang