



【2024-05-14】

中国央行今日开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，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。资金面整体宽松，7d repo fixing: 1.85%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 1.9770%，与上一交易日下降 0.6 个 bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.08%附近，震荡成交在 2.08%-2.0575%区间附近，午盘报收 06.75/06.50。中午回来，5y repo 小幅上行，成交在 2.0725%-2.0825%附近，报收 07.75/07.5。1y repo，震荡成交在 1.845%-1.8775%区间附近，下午尾盘报 87.75/87.50。其他期限，2y repo 成交在 2.8625%-2.885%附近。曲线方面，3x4y repo 成交在 07.25bp 附近，4x5y repo 成交在 07.25bp 附近，2x5y repo 成交在 20bp 附近，1x5y repo 成交在 20.5bp 附近，报收 20.25/20。

Shibor 端，今日成交清淡，1y shibor 报收 98.75/98.25，2y shibor 成交在 1.98%-1.9825%区间附近，5y shibor 报收 20.5/19.75，曲线方面，1x2y shibor 成交在 00bp 附近。基差方面，1y basis 成交在 10.75bp 附近，报收 11/10.75，5y basis 报收 12.5/11.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

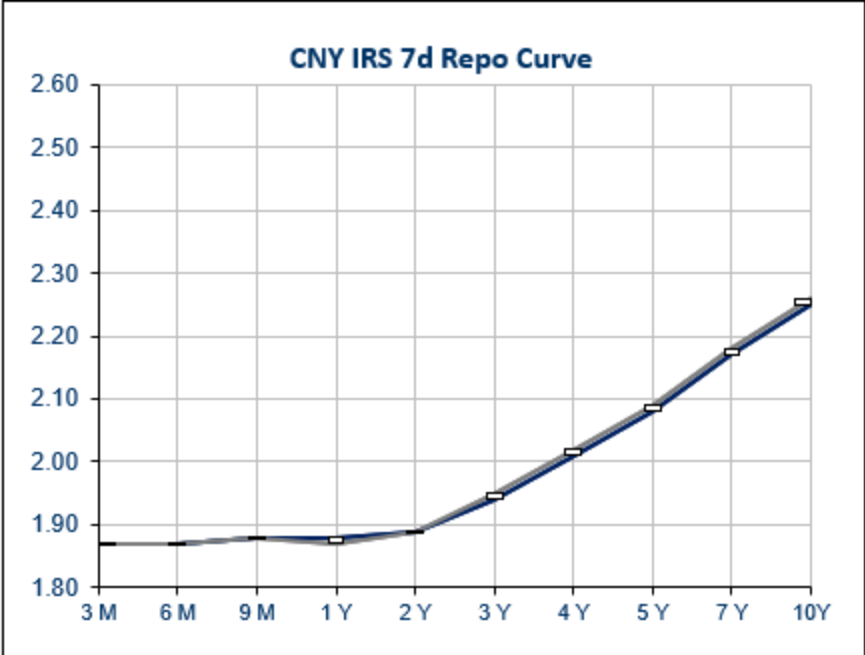
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/5/14 Tuesday

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	1.87	–				3 M	1.68	–						
6 M	1.87	–	6 M	1.97	1	6 M	1.67	1						
9 M	1.88	–	9 M	1.98	–	9 M	1.75	–						
1 Y	1.88	1	1 Y	1.98	1	1 Y	1.64	-1				1Y	1.87	–
2 Y	1.89	–	2 Y	1.99	–	2 Y	1.75	–	2 Y	1.65	–	2Y	1.86	-1
3 Y	1.94	-1	3 Y	2.05	–	3 Y	1.8	–	3 Y	1.77	–	3Y	1.91	-1
4 Y	2.01	-1	4 Y	2.13	–				4 Y	1.8	–	4Y	1.97	-1
5 Y	2.08	-1	5 Y	2.2	–				5 Y	1.8	–	5Y	2.04	-2
7 Y	2.17	-1	7 Y	2.3	–				7 Y	1.8	–			
10Y	2.25	-1	10Y	2.37	-1				10Y	1.8	–			
7D REPO	1.85	-3.00	3M Shibor	1.977	-0.60	0-N Shibor	1.769	-1.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0	–			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	–	1	-1				
9M*1Y	0	1	0	1	6M	10	1	
1*2Y	1	-1	1	-1	9M	10	–	
1*3Y	6	-2	7	-1	1Y	10	–	
1*4Y	13	-2	15	-1	2Y	10	–	
1*5Y	20	-2	22	-1	3Y	11	1	
2*3Y	5	-1	6	–	4Y	12	1	
2*4Y	12	-1	14	–	5Y	12	1	
2*5Y	19	-1	21	–				
3*4Y	7	–	8	–				
3*5Y	14	–	15	–				
4*5Y	7	–	7	–				
5*7Y	9	–	10	–				
5*10Y	17	–	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	1	24	5	34
今日	2	25	6	34



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:
以上所发及网站的所有信息 (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, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国脉货币”) 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, 所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang