



【2024-05-22】

 中国人民银行今日进行 20 亿元 7 天期逆回购操作，利率持平 1.8%。今日有 20 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing：1.85%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.9580%，与上一交易日不变。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.08%附近，后小幅震荡下行，成交在 2.0775%-2.0675%区间附近，午盘报收 6.75/6.5。中午回来，5y repo 小幅上行，震荡 2.065%-2.075%区间附近，报收 07.25/07。1y repo 全天震荡成交在 1.85%-1.87%区间附近，尾盘报收 86.75/86.5。其他期限，6m repo 成交在 1.865%附近，2y repo 成交在 1.8675%-1.87%附近，3y repo 成交在 1.915%-1.925%附近，4y repo 成交在 2.00%-1.9975%附近。曲线方面，6mx1y repo 成交在-0.25bp 点位，3x5y repo 成交在 15bp 点位，2x5y repo 成交在 20bp 点位，2x3x5y repo fly 成交在-10.5- -10.375bp 点位，1x5y repo 成交在 20.75bp 点位，报收 20.75/20.25。

 Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 00/99.5，5y shibor 报收 21/20.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 21.25/20.5。基差方面，1y basis 报收 13.5/13，5y basis 报收 14/13.5。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

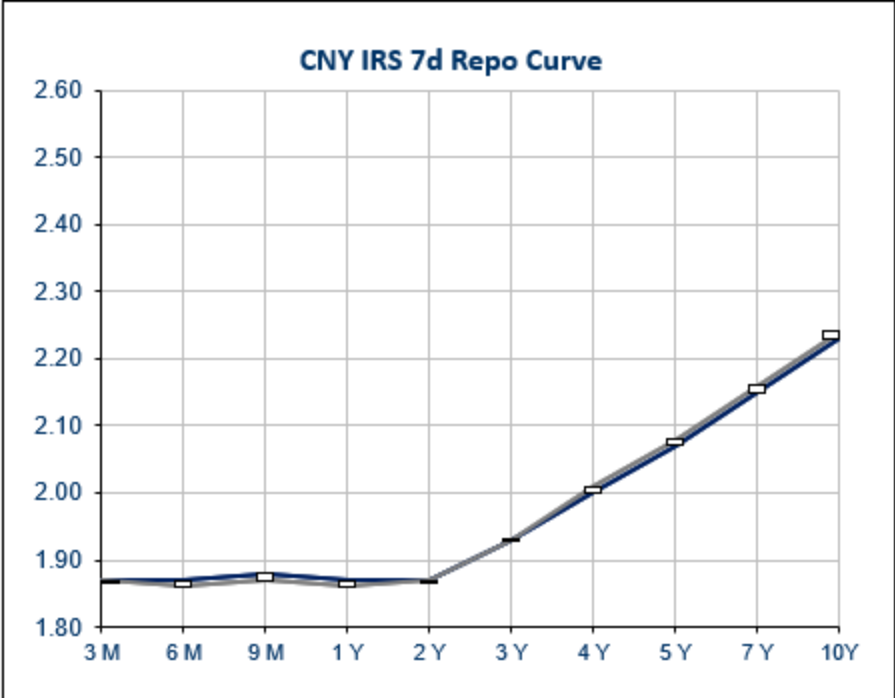
2024/5/22 Wednesday

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	—				3 M	1.68	—						
6 M	1.87	1	6 M	1.96	—	6 M	1.66	—						
9 M	1.88	1	9 M	2	—	9 M	1.67	—						
1 Y	1.87	1	1 Y	2	—	1 Y	1.64	—				1Y	1.86	—
2 Y	1.87	—	2 Y	2	-1	2 Y	1.66	-1	2 Y	1.65	—	2Y	1.86	—
3 Y	1.93	—	3 Y	2.05	-1	3 Y	1.75	—	3 Y	1.77	—	3Y	1.91	—
4 Y	2	-1	4 Y	2.13	-1				4 Y	1.8	—	4Y	1.96	—
5 Y	2.07	-1	5 Y	2.21	-1				5 Y	1.8	—	5Y	2.03	-1
7 Y	2.15	-1	7 Y	2.31	-1				7 Y	1.8	—			
10Y	2.23	-1	10Y	2.38	-2				10Y	1.8	—			
7D REPO	1.85	—	3M Shibor	1.958	—	0-N Shibor	1.779	2.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	—	4	—				
9M*1Y	-1	—	0	—	6M	9	-1	
1*2Y	0	-1	0	-1	9M	12	-1	
1*3Y	6	-1	5	-1	1Y	13	-1	
1*4Y	13	-2	13	-1	2Y	13	-1	
1*5Y	20	-2	21	-1	3Y	12	-1	
2*3Y	6	—	5	—	4Y	13	—	
2*4Y	13	-1	13	—	5Y	14	—	
2*5Y	20	-1	21	—				
3*4Y	7	-1	8	—				
3*5Y	14	-1	16	—				
4*5Y	7	—	8	—				
5*7Y	8	—	10	—				
5*10Y	16	—	17	-1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	41	37	36	36	35
今日	47	44	41	37	36	36	35

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	27	7	37
今日	3	27	7	38



联系人: Ruby Hu
邮箱: visiting.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:
以上所述及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的利/或者专用的信息。其知识产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”) 或第三方。“信息”不能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、建议或建议。“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, 所有陈述和保证均被明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang