



【2024-05-27】

中国央行今日开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，利率持平 1.80%。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。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日上升 13bp，3m shibor fixing: 1.9580%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.075%附近，后震荡成交在 2.075%-2.0825%区间附近，午盘报收 07.75/07.50。中午回来，5y repo 下行，成交在 2.075%-2.0625%区间附近，报收 06.5/06.25。1y repo 全天震荡成交在 1.865%-1.8825%区间附近，尾盘报收 86.75/86.25。

其他期限，3m repo 成交在 1.885%附近，6m repo 成交在 1.875% 附近，9m repo 成交在 1.8825%附近，2y repo 成交在 1.88%-1.89%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在-1bp, 6mx9m repo 成交在 00.75bp 附近，9mx1y repo 成交在-1bp 附近，1x2y repo 成交在 01bp 附近，1x5y repo 成交在 20-20.25bp 附近，报收 20.25/19.75 。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 00/99，5y shibor 报收 20/19.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 21.5/19。基差方面，1y basis 报收 13.5/12.5，5y basis 报收 13.75/12.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

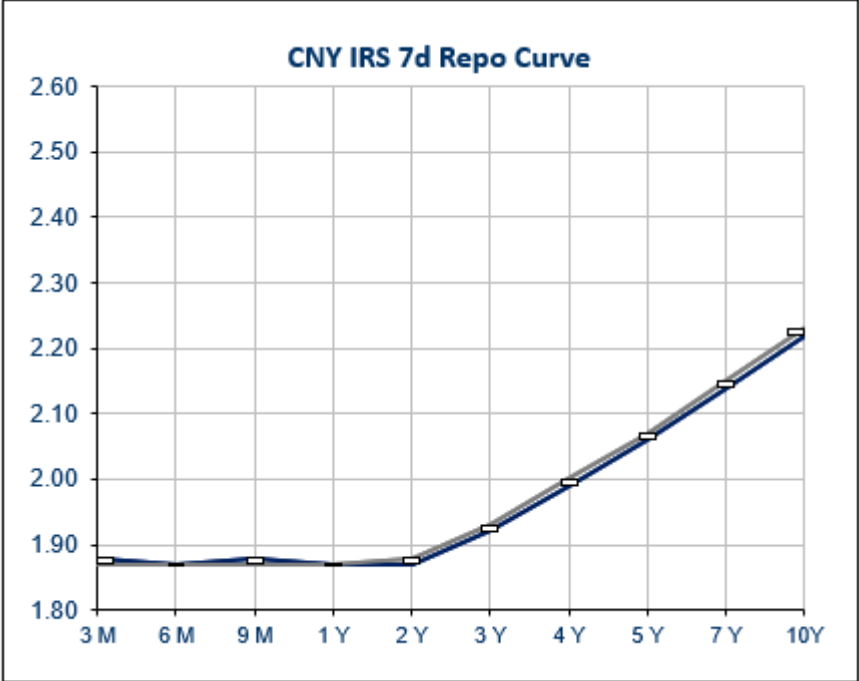
2024/5/27 Monday

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	1.88	1				3 M	1.68	3									
6 M	1.87	-	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 Y	2	1	1 Y	1.64	-				1Y	1.86	-			
2 Y	1.87	-1	2 Y	2.01	1	2 Y	1.66	-1	2 Y	1.65	-	2Y	1.86	-			
3 Y	1.92	-1	3 Y	2.05	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.9	-1			
4 Y	1.99	-1	4 Y	2.12	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.96	-			
5 Y	2.06	-1	5 Y	2.2	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.03	-			
7 Y	2.14	-1	7 Y	2.3	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.22	-1	10Y	2.38	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.95	13.00	3M Shibor	1.958	-	0-N Shibor	1.767	0.10	1Y DEPO	1.50							

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

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	43	41	37	36	35	35
今日	46	43	42	37	36	35	35

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	3	26	8	37
今日	4	27	8	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:
以上所述及所述的所有信息 (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市场经纪有限公司 (以下简称“上海国际”) 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