



【2024-05-23】

中国央行今日进行 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，当日实现零投放零回笼，资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.83%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.9570%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.06%附近，后小幅震荡上行，成交在 2.06%-2.065%区间附近，午盘报收 06.25/06。中午回来，5y repo 继续小幅震荡成交在 2.06%-2.065%区间附近，报收 06.5/06.25。1y repo 全天震荡成交在 1.855%-1.86%区间附近，尾盘报收 86/85.75。其他期限，3y repo 成交在 1.915%点位，4y repo 成交在 1.99%点位。曲线方面，3x5y repo 成交在 15bp 点位，4x5y repo 成交在 6.75-7bp 区间附近，1x5y repo 成交在 20.5bp 点位，报收 20.75/20.5。

Shibor 端，1y shibor 报收 99.25/98.75，3y shibor 成交在 2.04%点位，5y shibor 报收 19.5/19。曲线方面，6x9m shibor 成交在 4bp 点位，4x5y shibor 成交在 8bp 点位，1x5y shibor 报收 20.75/20。基差方面，1y basis 报收 13.5/13，3y basis 成交在 12.5bp 点位，5y basis 报收 13/12.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

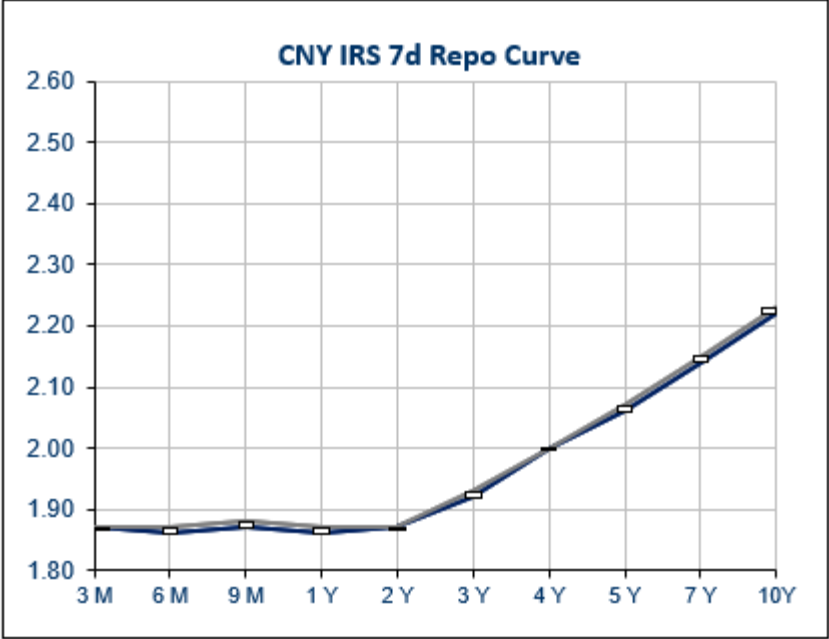
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/5/23 Thursday

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	1.86	−1	6 M	1.95	−1	6 M	1.66	—						
9 M	1.87	−1	9 M	1.99	−1	9 M	1.67	—						
1 Y	1.86	−1	1 Y	1.99	−1	1 Y	1.64	—				1Y	1.86	—
2 Y	1.87	—	2 Y	1.99	−1	2 Y	1.66	—	2 Y	1.65	—	2Y	1.86	—
3 Y	1.92	−1	3 Y	2.04	−1	3 Y	1.8	5	3 Y	1.77	—	3Y	1.9	−1
4 Y	2	—	4 Y	2.11	−2				4 Y	1.8	—	4Y	1.95	−1
5 Y	2.06	−1	5 Y	2.19	−2				5 Y	1.8	—	5Y	2.02	−1
7 Y	2.14	−1	7 Y	2.29	−2				7 Y	1.8	—			
10Y	2.22	−1	10Y	2.38	—				10Y	1.8	—			
7D REPO	1.83	−2.00	3M Shibor	1.957	−0.10	0-N Shibor	1.769	−1.00	1Y DEPO	1.50				

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

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	3	27	7	38
今日	3	27	7	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:
以上所述及附带的任何信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的、或有专权的、或知识产权属于上海国新证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国新证券”) 或其三方。“信息”不应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、建议或意见。“信息”不可作为投资决策、也不保证其准确性、及时性或及时性等要求, 且可未经通知而进行修改, 所有前述和保证均按协议条款严格。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang