



【2024-05-24】

中国央行今日进行 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。7d repo fixing: 1.82%，与上一交易日下降 1bp，3m shibor fixing: 1.9580%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.055%附近，后震荡上行，成交在 2.055%-2.07%区间附近，午盘报收 07/06.50。中午回来，5y repo 小幅震荡，成交在 2.0675%-2.0775%区间附近，报收 07.50/07.25。1y repo 全天震荡成交在 1.8525%-1.87%区间附近，尾盘报收 86.75/86.5。

其他期限，2y repo 成交在 1.8675%附近。曲线方面，1x2y repo 成交在 01bp 附近，1x5y repo 成交在 20.75bp 附近，1x5y repo 报收 21/20.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 成交在 1.99%附近，报收 99.5/99.25，5y shibor 成交在 2.19%-2.205%附近，报收 20.25/20。曲线方面，1x5y shibor 报收 21/20.75。基差方面，1y basis 报收 12.75/12.5，5y basis 成交在 12.75bp 附近，报收 13/12.75。

LPR 端，9m LPR_1y 成交在 3.425%附近，尾盘报收 43/42.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

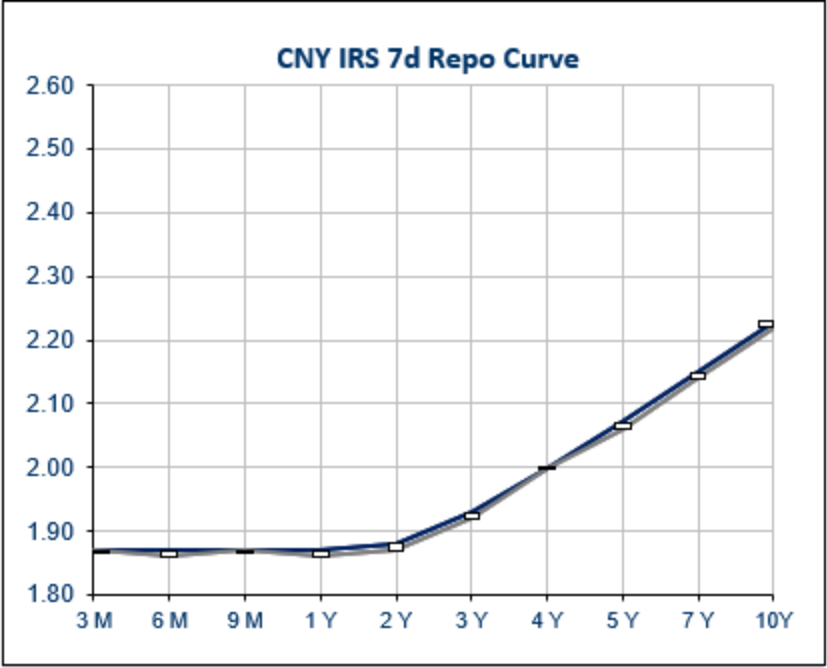
2024/5/24 Friday

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	1.65	-3									
6 M	1.87	1	6 M	1.96	1	6 M	1.66	–									
9 M	1.87	–	9 M	2	1	9 M	1.67	–									
1 Y	1.87	1	1 Y	1.99	–	1 Y	1.64	–				1Y	1.86	–			
2 Y	1.88	1	2 Y	2	1	2 Y	1.67	1	2 Y	1.65	–	2Y	1.86	–			
3 Y	1.93	1	3 Y	2.05	1	3 Y	1.75	-5	3 Y	1.77	–	3Y	1.91	1			
4 Y	2	–	4 Y	2.12	1				4 Y	1.8	–	4Y	1.96	1			
5 Y	2.07	1	5 Y	2.2	1				5 Y	1.8	–	5Y	2.03	1			
7 Y	2.15	1	7 Y	2.3	1				7 Y	1.8	–						
10Y	2.23	1	10Y	2.38	–				10Y	1.8	–						
7D REPO	1.82	-1.00	3M Shibor	1.958	0.10	0-N Shibor	1.766	-0.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	-1	4	–				
9M*1Y	0	1	-1	-1	6M	9	–	
1*2Y	1	–	1	1	9M	13	1	
1*3Y	6	–	6	1	1Y	12	-1	
1*4Y	13	-1	13	1	2Y	12	–	
1*5Y	20	–	21	1	3Y	12	–	
2*3Y	5	–	5	–	4Y	12	1	
2*4Y	12	-1	12	–	5Y	13	–	
2*5Y	19	–	20	–				
3*4Y	7	-1	7	–				
3*5Y	14	–	15	–				
4*5Y	7	1	8	–				
5*7Y	8	–	10	–				
5*10Y	16	–	18	-1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	41	37	36	36	35
今日	47	43	41	37	36	35	35

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	3	27	7	38
今日	3	26	8	37



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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的、或者专用的信息。其知识仅属于上海国际货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际货币”) 或其三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资策略或任何交易策略相关的推介、定价、建议或请求。“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