

收盘日评 银行间利率衍生品市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-05-28】

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。7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.957%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.0625%附近，后震荡成交在 2.07%-2.055%区间附近，午盘报收 06/05.75。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 2.055%-2.0425%区间附近，报收 4.75/4.5。1y repo 全天震荡成交在 1.87%-1.855%区间附近，尾盘报收 86/85.5。其他期限，9m repo 成交在 1.8725%附近，2y repo 成交在 1.87%附近，4y repo 成交在 1.9975%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在 -1bp 点位，1x2y repo 成交在 0.75bp 点位，4x5y repo 成交在 6.75bp 点位，1x5y repo 成交在 19.75-18.75bp 区间附近，曲线走平，报收 19/18.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 99/98.25，5y shibor 报收 18.5/17.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 20.25/18.25。基差方面，1y basis 报收 13/12.25，5y basis 报收 13.5/12.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

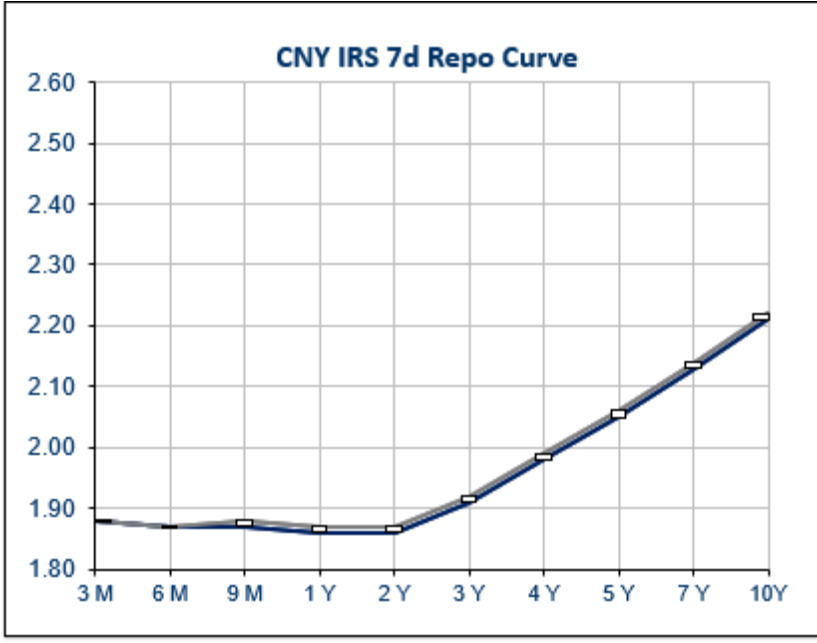
2024/5/28 Tuesday

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	1.88	-				3 M	1.68	-						
6 M	1.87	-	6 M	1.95	-1	6 M	1.66	-						
9 M	1.87	-1	9 M	1.99	-1	9 M	1.66	-1						
1 Y	1.86	-1	1 Y	1.99	-1	1 Y	1.63	-1				1Y	1.86	-
2 Y	1.86	-1	2 Y	1.99	-2	2 Y	1.66	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.85	-1
3 Y	1.91	-1	3 Y	2.04	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.89	-1
4 Y	1.98	-1	4 Y	2.1	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.95	-1
5 Y	2.05	-1	5 Y	2.18	-2				5 Y	1.8	-	5Y	2.01	-2
7 Y	2.13	-1	7 Y	2.28	-2				7 Y	1.8	-			
10Y	2.21	-1	10Y	2.37	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.95	-	3M Shibor	1.957	-0.10	0-N Shibor	1.81	4.30	1Y DEPO	1.50				

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

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	46	43	42	37	36	35	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	4	27	8	38
今日	3	27	8	38



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:
 以上所述及附带的任何信息 (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