



【2024-05-31】

中国央行今日进行 1000 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。今日有 20 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.88%，与上一交易日下降 7bp，3m shibor fixing: 1.9550%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.055%附近，后稍微震荡下行，成交在 2.0525%-2.0375%附近，又小幅回调，成交在 2.04%-2.05%区间附近，午盘报收 04.75/04.25。中午回来，5y repo 继续震荡上行，成交在 2.0475%-2.06%区间附近，报收 06/05.75。1y repo 全天震荡成交在 1.8375%-1.85%区间附近，尾盘报收 84.75/84.5。其他期限，6m repo 成交在 1.845%附近，9m repo 成交在 1.85%-1.8475%附近，2y repo 成交在 1.855%-1.8525%附近，3y repo 成交在 1.90%-1.9025%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-0.5bp 附近，2x3y repo 成交在 4.5-5bp 附近，1x5y repo 成交在 20-21.25bp 附近，曲线走陡，报收 21.25/21。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 96.5/95.5，5y shibor 报收 19/18.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 23/22。基差方面，1y basis 报收 11.75/11，5y basis 报收 13/12.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

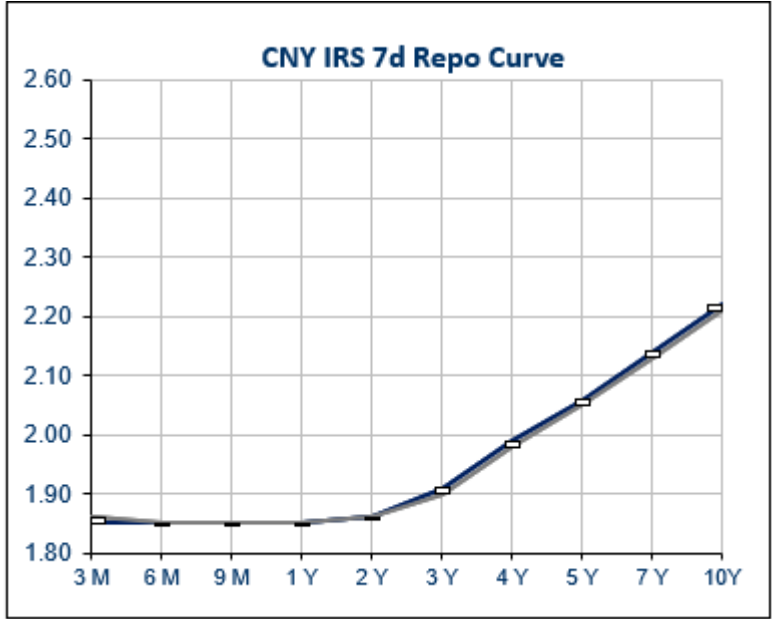
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/5/31 Friday

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	1.85	-1				3 M	1.7	-5									
6 M	1.85	-	6 M	1.93	-1	6 M	1.65	-5									
9 M	1.85	-	9 M	1.97	-1	9 M	1.7	-5									
1 Y	1.85	-	1 Y	1.96	-	1 Y	1.7	-5				1Y	1.85	-			
2 Y	1.86	-	2 Y	1.97	-	2 Y	1.7	-5	2 Y	1.65	-	2Y	1.86	1			
3 Y	1.91	1	3 Y	2.03	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.9	1			
4 Y	1.99	1	4 Y	2.11	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.96	1			
5 Y	2.06	1	5 Y	2.19	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.03	2			
7 Y	2.14	1	7 Y	2.29	1				7 Y	1.8	-						
10Y	2.22	1	10Y	2.38	2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.88	-7.00	3M Shibor	1.955	-0.20	0-N Shibor	1.805	5.90	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS		SHIBOR-REPO	
3M*6M	0	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	-	4	-				
9M*1Y	0	-	-1	1	6M	8	-1	
1*2Y	1	-	1	-	9M	12	-1	
1*3Y	6	1	7	-	1Y	11	-	
1*4Y	14	1	15	1	2Y	11	-	
1*5Y	21	1	23	2	3Y	12	-1	
2*3Y	5	1	6	-	4Y	12	-	
2*4Y	13	1	14	1	5Y	13	1	
2*5Y	20	1	22	2				
3*4Y	8	-	8	1				
3*5Y	15	-	16	2				
4*5Y	7	-	8	1				
5*7Y	8	-	10	-1				
5*10Y	16	-	19	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	46	43	42	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	4	28	8	38
今日	2	28	6	38



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting.bu@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, 且为保密的利/或者专用的信息。其知识产权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任何投资建议工具。投资者在任何交易决策前相关的推介、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