



【2024-05-16】

中国央行今日进行 20 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。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing：1.82%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.9690%，与上一交易日下降-0.6bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.0975%附近，后震荡成交在 2.094%-2.105%区间附近，午盘报收 9.75/9.5。中午回来，5y repo 稍微震荡上行，成交到 2.115%位置，后震荡成交在 2.115%-2.1025%区间附近，报收 10.75/10.25。1y repo 全天震荡成交在 1.8775%-1.89%区间附近，尾盘报收 88.25/88。其他期限，9m repo 成交在 1.8825%附近，2y repo 成交在 1.895%附近，4y repo 成交在 2.0325%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-0.5bp 附近，4x5y repo 成交在 7.25bp 附近，1x5y repo 成交在 21.25-22.5bp 附近，曲线走陡，报收 22.75/22。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 00/99，5y shibor 报收 23.5/23。曲线方面，1x5y shibor 报收 24.5/23。基差方面，1y basis 报收 11.75/10.75，5y basis 报收 12.75/12.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

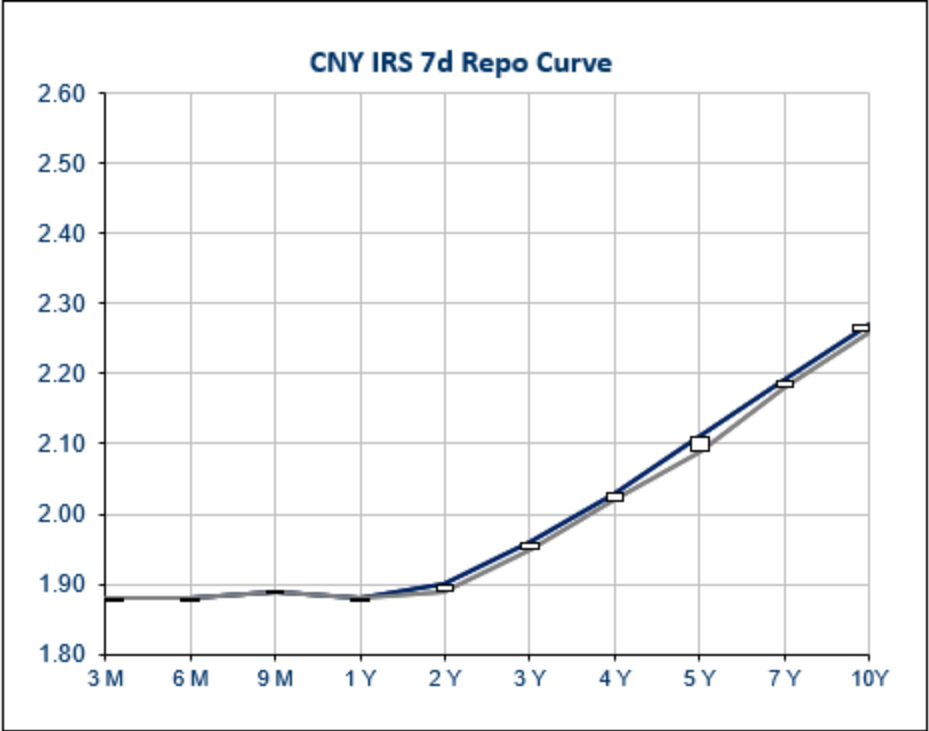
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/5/16 Thursday

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	1.88	–				3 M	1.68	–									
6 M	1.88	–	6 M	1.97	1	6 M	1.67	–									
9 M	1.89	–	9 M	2	1	9 M	1.7	–5									
1 Y	1.88	–	1 Y	2	1	1 Y	1.65	–				1Y	1.88	–			
2 Y	1.9	1	2 Y	2	1	2 Y	1.7	–5	2 Y	1.65	–	2Y	1.88	1			
3 Y	1.96	1	3 Y	2.08	2	3 Y	1.8	5	3 Y	1.77	–	3Y	1.93	1			
4 Y	2.03	1	4 Y	2.16	2				4 Y	1.8	–	4Y	1.99	1			
5 Y	2.11	2	5 Y	2.23	2				5 Y	1.8	–	5Y	2.07	2			
7 Y	2.19	1	7 Y	2.33	2				7 Y	1.8	–						
10Y	2.27	1	10Y	2.41	3				10Y	1.8	–						
7D REPO	1.82	–	3M Shibor	1.969	–0.60	0-N Shibor	1.724	–0.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0	–		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	–	3	–			
9M*1Y	–1	–	0	–	6M	9	1
1*2Y	2	1	0	–	9M	11	1
1*3Y	8	1	8	1	1Y	12	1
1*4Y	15	1	16	1	2Y	10	–
1*5Y	23	2	23	1	3Y	12	1
2*3Y	6	–	8	1	4Y	13	1
2*4Y	13	–	16	1	5Y	12	–
2*5Y	21	1	23	1			
3*4Y	7	–	8	–			
3*5Y	15	1	15	–			
4*5Y	8	1	7	–			
5*7Y	8	–1	10	–			
5*10Y	16	–1	18	1			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	45	43	41	37	35	33	33
今日	46	43	42	37	36	34	33

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	25	6	34
今日	1	24	5	34



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:
以上所述及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 并非投资建议/或者有别的信息, 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报价、定价、建议或推荐。“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, 所有前述和保证均按明确免责声明声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang