



【2024-06-06】

中国央行今日开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。因今日有 2600 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2580 亿元。7d repo fixing: 1.84%，与上一交易日持平，3m shibor fixing: 1.9530%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.025%附近，震荡成交在 2.0275%-2.015%附近，午盘报收 02.5/02。午后，5y repo 继续震荡，成交在 2.0225%-2.0175%区间附近，报收 02.5/02。1y repo 全天震荡成交在 1.825%-1.8325%区间附近，尾盘报收 83/82.5。其他期限，6m repo 成交在 1.83%附近，9m repo 成交在 1.835%附近，2y repo 成交在 1.8325%附近，4y repo 成交 1.955%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 0.5bp 附近。9mx1y repo 成交在-0.75bp 附近，1x2y repo 成交 par 和 0.25bp 附近。1x5y repo 成交在 19-19.25bp 附近，报收 19.75/19.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 95.75/95.25，5y shibor 报收 14.5/14。曲线方面，1x5y shibor 报收 19.25/18.5。基差方面，1y basis 报收 12.75/12.25，5y basis 报收 12.5/12。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

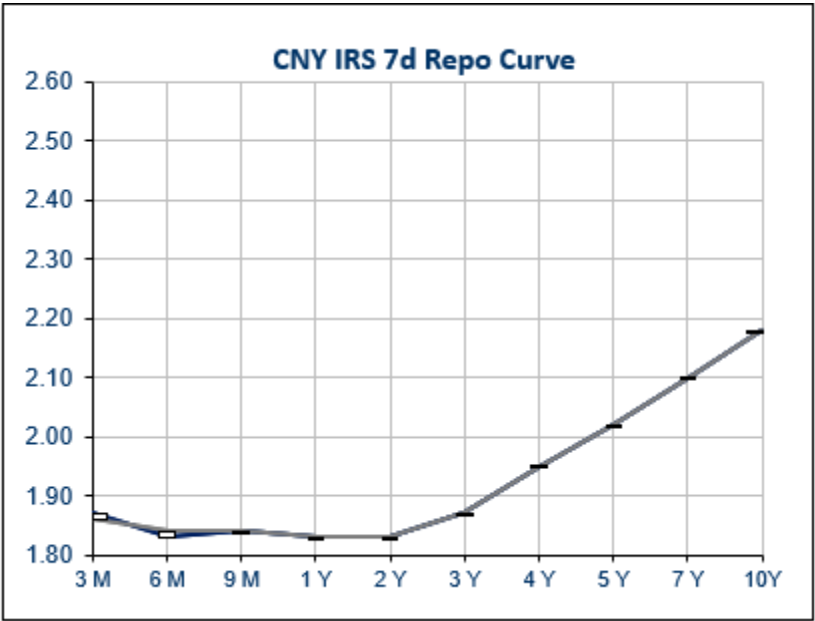
2024/6/6 Thursday

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	1				3 M	1.68	1									
6 M	1.83	-1	6 M	1.92	-	6 M	1.65	-									
9 M	1.84	-	9 M	1.97	-	9 M	1.65	-									
1 Y	1.83	-	1 Y	1.96	1	1 Y	1.62	-				1Y	1.83	-			
2 Y	1.83	-	2 Y	1.95	-	2 Y	1.64	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.83	1			
3 Y	1.87	-	3 Y	1.99	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.87	1			
4 Y	1.95	-	4 Y	2.08	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.93	1			
5 Y	2.02	-	5 Y	2.14	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.99	-			
7 Y	2.1	-	7 Y	2.25	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.18	-	10Y	2.35	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.84	-	3M Shibor	1.948	-	0-N Shibor	1.656	-0.80	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-2			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	1	5	-				
9M*1Y	-1	-	-1	1	6M	9	1	
1*2Y	0	-	-1	-1	9M	13	-	
1*3Y	4	-	3	-1	1Y	13	1	
1*4Y	12	-	12	-	2Y	12	-	
1*5Y	19	-	18	-1	3Y	12	-	
2*3Y	4	-	4	-	4Y	13	1	
2*4Y	12	-	13	1	5Y	12	-	
2*5Y	19	-	19	-				
3*4Y	8	-	9	1				
3*5Y	15	-	15	-				
4*5Y	7	-	6	-1				
5*7Y	8	-	11	-				
5*10Y	16	-	21	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	43	41	37	35	34	32
今日	47	44	42	37	35	34	32

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	30	7	38
今日	2	30	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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限公司 (以下简称“上海国脉货币”) 或其三方。“信息”不应也不应被解释为与任何金融工具、股票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, 且可未经通知的进行修改, 所有前述和保证均按协议免责声明处理。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang