



【2024-06-07】

 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 1000 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.85%，与上一交易日上升 1bp，3m shibor fixing: 1.9490%，与上一交易日上升 0.1bp。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.0225%附近，后小幅震荡下行，成交在 2.0225%-2.0175%附近，午盘报收 02/01.75。中午回来，5y repo 继续小幅震荡下行，成交在 2.0175%-2.0125%区间附近，报收 01.75/01.5。1y repo 全天震荡成交在 1.83%-1.825%区间附近，尾盘报收 83.25/82.75。其他期限，6m repo 成交在 1.83%附近，9m repo 成交在 1.835%附近，3y repo 成交在 1.875%-1.8825%附近，4y repo 成交在 1.955%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 0.5bp 点位，9mx1y repo 成交在-0.75bp 点位，3x4y repo 成交在 7.5bp 附近，1x5y repo 成交在 19bp 附近，报收 18.75/18.25。

 Shibor 端，1y shibor 成交在 1.955%附近，报收 96.75/96，5y shibor 成交在 2.135%附近，报收 14.25/13.5。曲线方面，1x5y shibor 成交在 18bp 附近，报收 18.25/17.5。基差方面，1y basis 报收 13.5/13，5y basis 报收 12.5/12。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

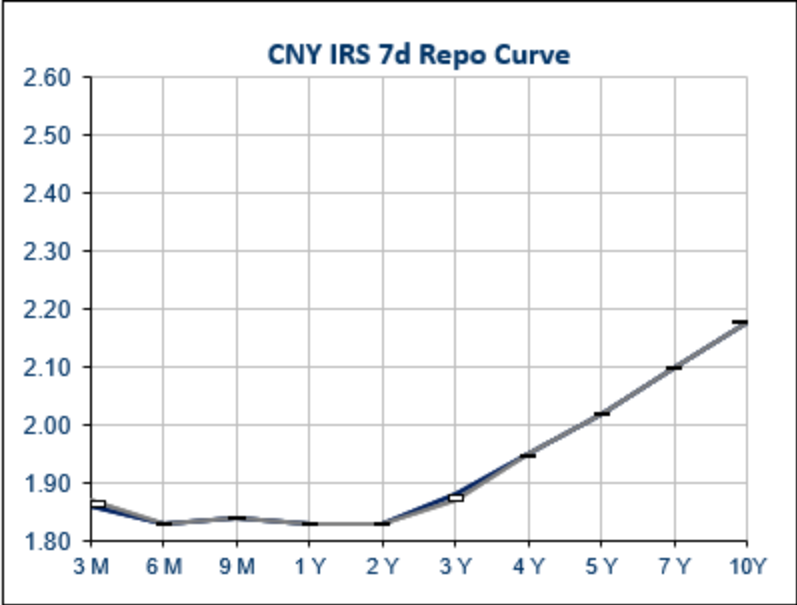
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/6/7 Friday

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	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.86	-1				3 M	1.67	-1									
6 M	1.83	-	6 M	1.93	1	6 M	1.64	-1									
9 M	1.84	-	9 M	1.98	1	9 M	1.65	-									
1 Y	1.83	-	1 Y	1.96	-	1 Y	1.62	-							1Y	1.83	-
2 Y	1.83	-	2 Y	1.95	-	2 Y	1.64	-	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.82	-1
3 Y	1.88	1	3 Y	1.99	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.86	-1
4 Y	1.95	-	4 Y	2.07	-1				4 Y	1.8	-	4 Y	1.8	-	4Y	1.92	-1
5 Y	2.02	-	5 Y	2.14	-				5 Y	1.8	-	5 Y	1.8	-	5Y	1.98	-1
7 Y	2.1	-	7 Y	2.25	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.18	-	10Y	2.34	-1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.85	1.00	3M Shibor	1.949	0.10	0-N Shibor	1.719	6.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	-	5	-				
9M*1Y	-1	-	-2	-1	6M	10	1	
1*2Y	0	-	-1	-	9M	14	1	
1*3Y	5	1	3	-	1Y	13	-	
1*4Y	12	-	11	-1	2Y	12	-	
1*5Y	19	-	18	-	3Y	11	-1	
2*3Y	5	1	4	-	4Y	12	-1	
2*4Y	12	-	12	-1	5Y	12	-	
2*5Y	19	-	19	-				
3*4Y	7	-1	8	-1				
3*5Y	14	-1	15	-				
4*5Y	7	-	7	1				
5*7Y	8	-	11	-				
5*10Y	16	-	20	-1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	42	37	35	34	32
今日	47	44	41	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	29	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:
以上所述及所加的所有信息 (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”) 或第三方。“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