



【2024-06-11】

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 40 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 20 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.83%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.9470%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.01%附近，后小幅震荡，成交在 2.005%-2.015%区间附近，午盘报收 00.5/00.25。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 2.00%-2.015%区间附近，报收 00.5/00.25。1y repo 全天震荡成交在 1.825%-1.8275%区间附近，尾盘报收 82.75/82.5。曲线方面，1x5y repo 成交在 17.75-18.25bp 区间附近，报收 17.75/17.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 95.75/95.25，5y shibor 报收 13.25 /12.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 17.75/17。基差方面，1y basis 报收 13.25/12.75，5y basis 成交在 12.5bp 点位，报收 12.75/12.5。

LPR 端，1y LPR_9m 成交在 3.44%，报收 44.5/43.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

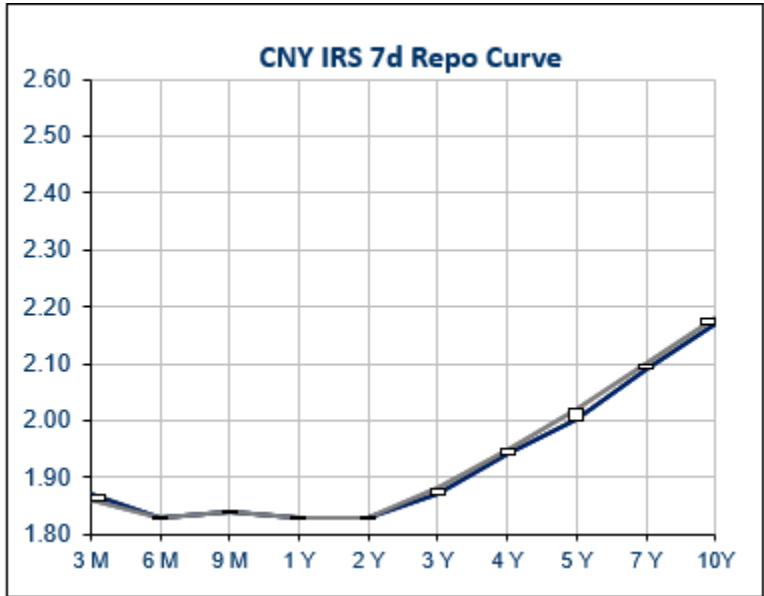
2024/6/11 Tuesday

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	1.87	1				3 M	1.67	–						
6 M	1.83	–	6 M	1.92	–1	6 M	1.65	1						
9 M	1.84	–	9 M	1.97	–1	9 M	1.66	1						
1 Y	1.83	–	1 Y	1.96	–	1 Y	1.61	–1				1Y	1.82	–1
2 Y	1.83	–	2 Y	1.95	–	2 Y	1.64	–	2 Y	1.65	–	2Y	1.82	–
3 Y	1.87	–1	3 Y	1.99	–	3 Y	1.75	–	3 Y	1.77	–	3Y	1.85	–1
4 Y	1.94	–1	4 Y	2.06	–1				4 Y	1.8	–	4Y	1.91	–1
5 Y	2	–2	5 Y	2.13	–1				5 Y	1.8	–	5Y	1.97	–1
7 Y	2.09	–1	7 Y	2.24	–1				7 Y	1.8	–			
10Y	2.17	–1	10Y	2.33	–1				10Y	1.8	–			
7D REPO	1.83	–2.00	3M Shibor	1.947	–0.20	0-N Shibor	1.679	–4.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	1	-	5	-				
9M*1Y	-1	-	-1	1	6M	9	-1	
1*2Y	0	-	-1	-	9M	13	-1	
1*3Y	4	-1	3	-	1Y	13	-	
1*4Y	11	-1	10	-1	2Y	12	-	
1*5Y	17	-2	17	-1	3Y	12	1	
2*3Y	4	-1	4	-	4Y	12	-	
2*4Y	11	-1	11	-1	5Y	13	1	
2*5Y	17	-2	18	-1				
3*4Y	7	-	7	-1				
3*5Y	13	-1	14	-1				
4*5Y	6	-1	7	-				
5*7Y	9	1	11	-				
5*10Y	17	1	20	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	41	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	29	7	38
今日	4	31	9	39



联系人: Ruby Wu
邮箱: viaoting.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:

以上所发及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/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、建议或诱导。“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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang