



【2024-06-03】

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 20 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现零投放零回笼。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.84%，与上一交易日下降 4bp，3m shibor fixing: 1.9530%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.06%附近，后稍微震荡下行，成交在 2.06%-2.0425%附近，午盘报收 04.5/04.25。中午回来，5y repo 继续震荡下行，成交在 2.045%-2.0375%区间附近，报收 04/03.75。1y repo 全天震荡成交在 1.8475%-1.83%区间附近，尾盘报收 83.75/83.25。其他期限，6m repo 成交在 1.83%附近，9m repo 成交在 1.8425%-1.8375%附近，2y repo 成交在 1.845%附近，3y repo 成交在 1.895%-1.8825%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 1.25-0.75bp。9mx1y repo 成交在 -0.5bp 附近，3x4y repo 成交 08.5bp，4x5y repo 成交在 07.25bp。1x5y repo 成交在 20.5bp 附近，报收 20.75/20.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 95.5/94.5，5y shibor 报收 16.5/16。曲线方面，1x5y shibor 报收 22/20.5。基差方面，1y basis 报收 12/11，5y basis 成交 12.75-12.5bp 附近，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

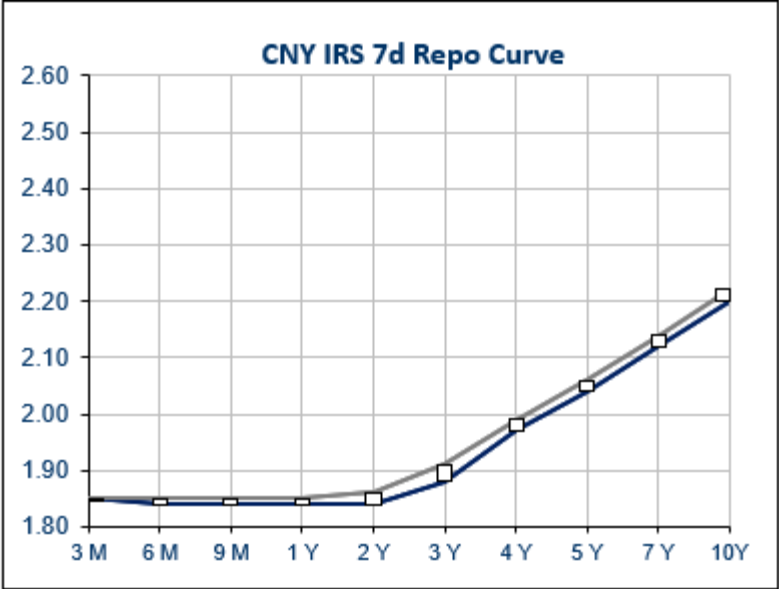
2024/6/3 Monday

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	—				3 M	1.67	-3						
6 M	1.84	-1	6 M	1.93	—	6 M	1.66	1						
9 M	1.84	-1	9 M	1.97	—	9 M	1.66	-4						
1 Y	1.84	-1	1 Y	1.95	-1	1 Y	1.65	-5				1Y	1.84	-1
2 Y	1.84	-2	2 Y	1.96	-1	2 Y	1.65	-5	2 Y	1.65	—	2Y	1.83	-3
3 Y	1.88	-3	3 Y	2.01	-2	3 Y	1.75	—	3 Y	1.77	—	3Y	1.88	-2
4 Y	1.97	-2	4 Y	2.08	-3				4 Y	1.8	—	4Y	1.94	-2
5 Y	2.04	-2	5 Y	2.16	-3				5 Y	1.8	—	5Y	2.01	-2
7 Y	2.12	-2	7 Y	2.27	-2				7 Y	1.8	—			
10Y	2.2	-2	10Y	2.37	-1				10Y	1.8	—			
7D REPO	1.84	-4.00	3M Shibor	1.935	-2.00	0-N Shibor	1.723	-8.20	1Y DEPO	1.50				

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

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	46	43	42	37	36	35	35
今日	47	43	41	37	36	35	35

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	28	6	38
今日	2	29	7	38



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:
以上所述及所包含的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的、或者专用的信息。其知识“仅属于上海国际货币经纪有限责任公司 (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、投资建议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