



【2024-06-17】

中国央行今日开展 40 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。中国央行今日开展 1820 亿元 1 年期 MLF 操作，因今日有 2370 亿元 1 年期中期借贷便利（MLF）到期，当日实现净回笼 510 亿元。资金面偏紧。7d repo fixing: 1.85%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 1.9350%，与上一交易日下降 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.015%附近，后小幅震荡上行，成交在 2.015%-2.03%区间附近，午盘报收 03.25/03。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.0275%-2.0325%区间附近，报收 03.25/03。1y repo 全天震荡成交在 1.8475%-1.8575%区间附近，尾盘报收 86/85.5。6m repo 成交在 1.8625%-1.8675%区间附近，9m repo 成交在 1.865%-1.8675%区间附近，2y repo 成交在 1.8625%附近。曲线方面，6x9m repo 成交在 00bp 点位，9mx1y repo 成交在 -01~-01.25bp 区间附近，1x5y repo 成交在 17.25bp 点位，报收 17.5/17。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 97.75/96.75，5y shibor 报收 15.5/15。曲线方面，1x5y shibor 报收 18.75/17.25。基差方面，1y basis 成交在 11.75bp 点位，报收 12/11.25，5y basis，报收 12.5/11.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

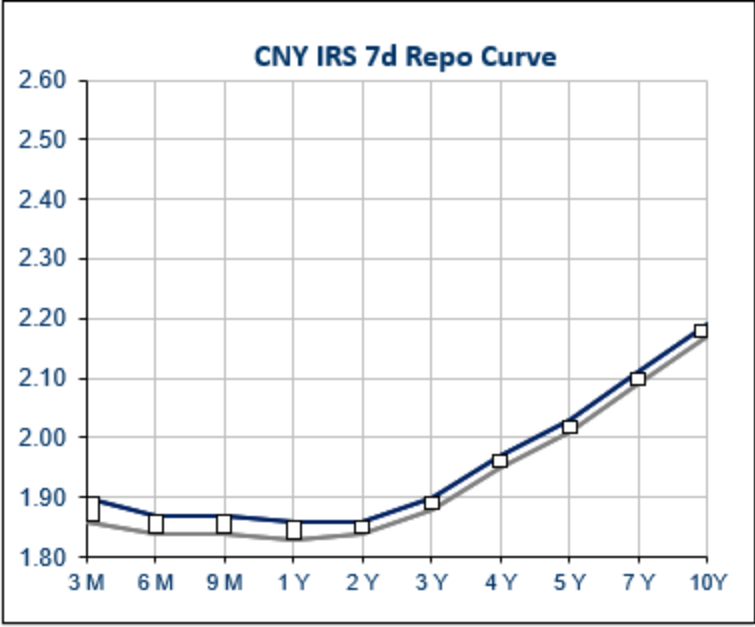
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/6/17 Monday

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	1.9	4				3 M	1.69	1						
6 M	1.87	3	6 M	1.94	1	6 M	1.67	2						
9 M	1.87	3	9 M	1.99	2	9 M	1.7	2						
1 Y	1.86	3	1 Y	1.97	1	1 Y	1.63	1				1Y	1.85	2
2 Y	1.86	2	2 Y	1.96	1	2 Y	1.66	1	2 Y	1.65	-	2Y	1.85	2
3 Y	1.9	2	3 Y	2.02	2	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.87	2
4 Y	1.97	2	4 Y	2.09	2				4 Y	1.8	-	4Y	1.93	2
5 Y	2.03	2	5 Y	2.15	2				5 Y	1.8	-	5Y	1.99	2
7 Y	2.11	2	7 Y	2.26	2				7 Y	1.8	-			
10Y	2.19	2	10Y	2.35	2				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.85	2.00	3M Shibor	1.935	-0.40	0-N Shibor	1.783	5.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	-	5	1				
9M*1Y	-1	-	-2	-1	6M	7	-2	
1*2Y	0	-1	-1	-	9M	12	-1	
1*3Y	4	-1	5	1	1Y	11	-2	
1*4Y	11	-1	12	1	2Y	10	-1	
1*5Y	17	-1	18	1	3Y	12	-	
2*3Y	4	-	6	1	4Y	12	-	
2*4Y	11	-	13	1	5Y	12	-	
2*5Y	17	-	19	1				
3*4Y	7	-	7	-				
3*5Y	13	-	13	-				
4*5Y	6	-	6	-				
5*7Y	8	-	11	-				
5*10Y	16	-	20	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	42	37	35	34	32
今日	47	44	42	38	36	35	33

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	3	29	8	37
今日	2	27	6	35



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting_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、投资策略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, 也不保证其所提供、对流动性或盈利性等要求, 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