



【2024-06-21】

中国人民银行今日进行 100 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，当日实现净投放 80 亿元。资金面上午偏紧，下午转松。7d repo fixing: 2.03%，与上一交易日上升 13bp，3m shibor fixing: 1.9230%，与上一交易日下降 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.0075%附近，后震荡成交在 2.005%-2.015%区间附近，午盘报收 01.5/01.25。中午回来，5y repo 继续小幅震荡，成交在 2.01%-2.0175%区间附近，报收 01/00.75。1y repo 全天震荡成交在 1.855%-1.865%区间附近，尾盘报收 85.75/85.25。其他期限，6m repo 成交在 1.885%附近，2y repo 成交在 1.8525%-1.86%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在 00~-00.25bp 区间附近，1x5y repo 成交在 15.25-15.5bp 区间附近，报收 15.5/15.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 96/95，2y shibor 成交在 1.95%，5y shibor 成交在 2.1275%，报收 11.75/11.5。曲线方面，2x5y shibor 成交在 16.75bp 点位，1x5y shibor 报收 16.5/15.5。基差方面，1y basis 报收 10.75/9.75，2y basis 成交在 9.75bp 点位，5y basis 成交在 11bp 点位，报收 11/10.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

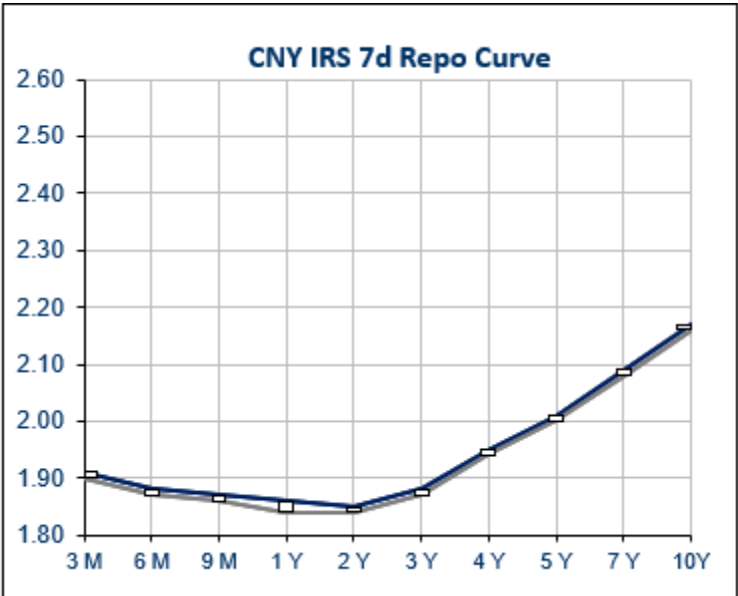
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/6/21 Friday

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
3 M	1.91	1				3 M	1.7	1						
6 M	1.88	1	6 M	1.92	-	6 M	1.67	-						
9 M	1.87	1	9 M	1.97	1	9 M	1.66	-						
1 Y	1.86	2	1 Y	1.96	1	1 Y	1.64	-2				1Y	1.85	1
2 Y	1.85	1	2 Y	1.95	1	2 Y	1.65	1	2 Y	1.65	-	2Y	1.84	2
3 Y	1.88	1	3 Y	1.99	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.86	2
4 Y	1.95	1	4 Y	2.05	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.92	1
5 Y	2.01	1	5 Y	2.12	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.97	1
7 Y	2.09	1	7 Y	2.23	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.17	1	10Y	2.33	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.03	13.00	3M Shibor	1.923	-0.40	0-N Shibor	1.96	8.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-1	-	5	1				
9M*1Y	-1	1	-1	-	6M	4	-1	
1*2Y	-1	-1	-1	-	9M	10	-	
1*3Y	2	-1	3	-1	1Y	10	-1	
1*4Y	9	-1	9	-1	2Y	10	-	
1*5Y	15	-1	16	-1	3Y	11	-1	
2*3Y	3	-	4	-1	4Y	10	-1	
2*4Y	10	-	10	-1	5Y	11	-1	
2*5Y	16	-	17	-1				
3*4Y	7	-	6	-				
3*5Y	13	-	13	-				
4*5Y	6	-	7	-				
5*7Y	8	-	11	-				
5*10Y	16	-	21	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	42	38	36	35	33
今日	47	44	41	37	35	34	33

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	28	5	36
今日	2	28	5	36



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:
以上所述及附带的信息 (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, 其知识产权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与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、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, 所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang