



【2024-06-05】

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。因今日有 2500 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现实现净回笼 2480 亿元，资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.84%，与上一交易日上升 1bp，3m shibor fixing: 1.948%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.04%附近，后震荡成交在 2.04%-2.025%区间附近，午盘报收 02.75/02.50。中午回来，5y repo 震荡成交，尾盘小幅下行，成交在 2.03%-2.0175%附近，报收 02/01.75。1y repo 全天震荡成交在 1.835%-1.8275%区间附近，尾盘报收 83.25/83。其他期限，2y repo 成交在 1.835%-1.83%附近，3y repo 成交在 1.88%附近。曲线方面，1x2y repo 成交在 0.25bp 点位，1x5y repo 成交在 19.75-20bp 点位，报收 19/18.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 95.5/94.75，5y shibor 报收 14.5/13.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 19.75/18.5。基差方面，1y basis 报收 12.25/11.75，5y basis 报收 12.5/12。

LPR 端，9m LPR_1Y 成交在 3.435%附近，尾盘报收 43.5/43，1y LPR_1Y 成交在 3.415%附近，尾盘报收 42/41.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

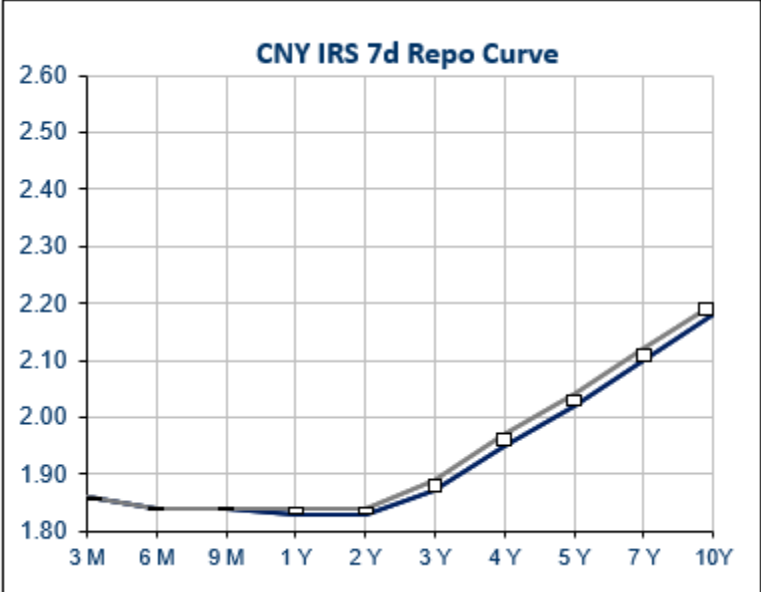
2024/6/5 Wednesday

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	1.86	—				3 M	1.67	—						
6 M	1.84	—	6 M	1.92	-1	6 M	1.65	—						
9 M	1.84	—	9 M	1.97	—	9 M	1.65	-1						
1 Y	1.83	-1	1 Y	1.95	-1	1 Y	1.62	—				1Y	1.83	-1
2 Y	1.83	-1	2 Y	1.95	-1	2 Y	1.64	-1	2 Y	1.65	—	2Y	1.82	-2
3 Y	1.87	-2	3 Y	1.99	-2	3 Y	1.75	—	3 Y	1.77	—	3Y	1.86	-2
4 Y	1.95	-2	4 Y	2.07	-1				4 Y	1.8	—	4Y	1.92	-2
5 Y	2.02	-2	5 Y	2.14	-2				5 Y	1.8	—	5Y	1.99	-2
7 Y	2.1	-2	7 Y	2.25	-2				7 Y	1.8	—			
10Y	2.18	-2	10Y	2.35	-2				10Y	1.8	—			
7D REPO	1.84	1.00	3M Shibor	1.948	-0.10	0-N Shibor	1.664	0.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	-	5	1				
9M*1Y	-1	-1	-2	-1	6M	8	-1	
1*2Y	0	-	0	-	9M	13	-	
1*3Y	4	-1	4	-1	1Y	12	-	
1*4Y	12	-1	12	-	2Y	12	-	
1*5Y	19	-1	19	-1	3Y	12	-	
2*3Y	4	-1	4	-1	4Y	12	1	
2*4Y	12	-1	12	-	5Y	12	-	
2*5Y	19	-1	19	-1				
3*4Y	8	-	8	1				
3*5Y	15	-	15	-				
4*5Y	7	-	7	-1				
5*7Y	8	-	11	-				
5*10Y	16	-	21	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	43	41	37	36	35	35
今日	47	43	41	37	35	34	32

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	29	6	37
今日	2	30	7	38



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiating.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/或者专用的信息, 其知识产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、及时性或准确性等需求, 且可未经通知而进行修改, 所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang