



【2024-06-18】

中国央行今日进行 860 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 840 亿，资金面上午偏紧，下午转松。7d repo fixing: 1.89%，与上一交易日上升 4bp，3m shibor fixing: 1.934%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.025%附近，后震荡下行，成交在 2.0275%-2.0175%区间附近，午盘报收 02/01.75。中午回来，5y repo 小幅震荡，成交在 2.0125%-2.0225%附近，报收 02.5/02。1y repo 全天震荡成交在 1.8575%-1.85%区间附近，尾盘报收 85.75/85.5。其他期限，6m repo 成交在 1.8675%-1.875%区间附近，9m repo 成交在 1.865%-1.8725%区间附近，4y repo 成交在 1.965%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 -00.25bp 附近，9mx1y 成交在 -01 到 -01.5bp 附近，4x5y repo 成交在 06.25bp 点位，1x5y repo 成交在 16.5-16.75bp 点位，报收 16.75/16.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 97.25/96.5，5y shibor 成交在 2.14%附近，报收 14.5/13.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 18/16.5。基差方面，1y basis 报收 11.75/11，5y basis 报收 12.25/11.75。

LPR 端，6m LPR_1Y 成交在 3.47%附近，尾盘报收 47/46.5，1y LPR_5Y 成交在 3.89%附近，尾盘报收 90/89。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

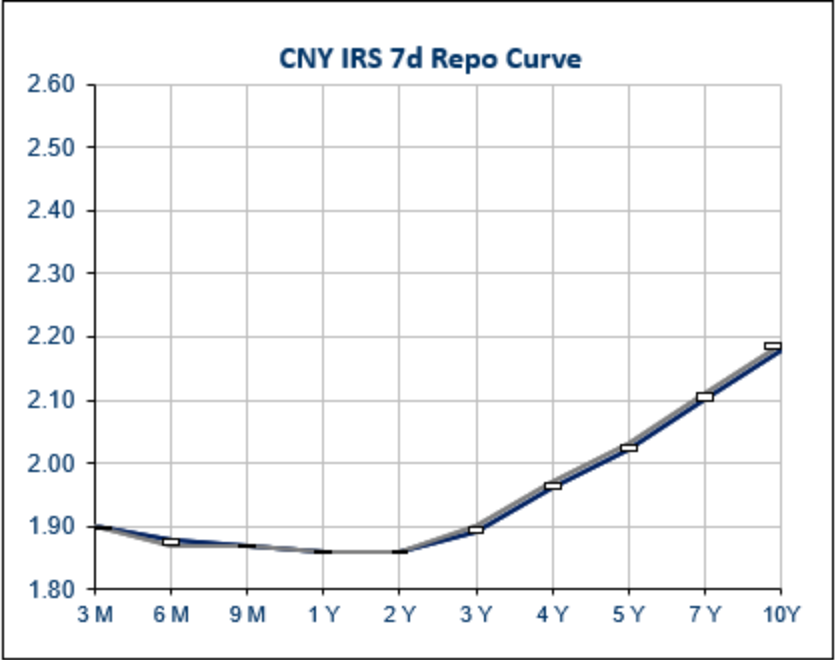
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/6/18 Tuesday

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-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	–				3 M	1.69	–						
6 M	1.88	1	6 M	1.94	–	6 M	1.67	–						
9 M	1.87	–	9 M	1.98	-1	9 M	1.7	–						
1 Y	1.86	–	1 Y	1.97	–	1 Y	1.64	1				1Y	1.85	–
2 Y	1.86	–	2 Y	1.96	–	2 Y	1.66	–	2 Y	1.65	–	2Y	1.84	-1
3 Y	1.89	-1	3 Y	2.01	-1	3 Y	1.75	–	3 Y	1.77	–	3Y	1.86	-1
4 Y	1.96	-1	4 Y	2.07	-2				4 Y	1.8	–	4Y	1.92	-1
5 Y	2.02	-1	5 Y	2.14	-1				5 Y	1.8	–	5Y	1.98	-1
7 Y	2.1	-1	7 Y	2.25	-1				7 Y	1.8	–			
10Y	2.18	-1	10Y	2.34	-1				10Y	1.8	–			
7D REPO	1.89	4.00	3M Shibor	1.934	-0.10	O-N Shibor	1.829	4.60	1Y DEPO	1.50				

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

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	42	38	36	35	33
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	2	27	6	35
今日	2	27	6	35



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:
以上所发及网站的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的利/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”本身也不应被解释为与任何金融工具、股票或任何交易策略相关的推介、定价、建议或诱导。“信息”不可作为投资决策, 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