



【2024-07-09】

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 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：1.87%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.9070%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.0275%附近，后震荡下行，成交在 2.0275%-2.0125%附近，午盘报收 01.25/01。中午回来，5y repo 继续小幅震荡，成交在 2.02%-2.0075%区间附近，报收 01/00.75。1y repo 全天震荡成交在 1.8775%-1.8725%区间附近，报收 87/86.75。其他期限，6m repo 成交在 1.9025%-1.895%附近，9m repo 成交在 1.89%-1.885%区间附近，2y repo 成交在 1.8675%-1.8575%区间附近，3y repo 成交在 1.89%-1.8875%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 -1.25bp 点位，9mx1y repo 成交在 -1.75bp 点位，1x3y repo 成交在 1.75bp 点位，3x5y repo 成交在 12.75-11.75bp 区间附近，1x5y repo 成交在 14.5-14.25bp 点位，报收 14.25/13.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 96/94.75，5y shibor 报收 11.25/10.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 16.5/14.75。基差方面，1y basis 报收 9/8，5y basis 报收 10.25/9.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

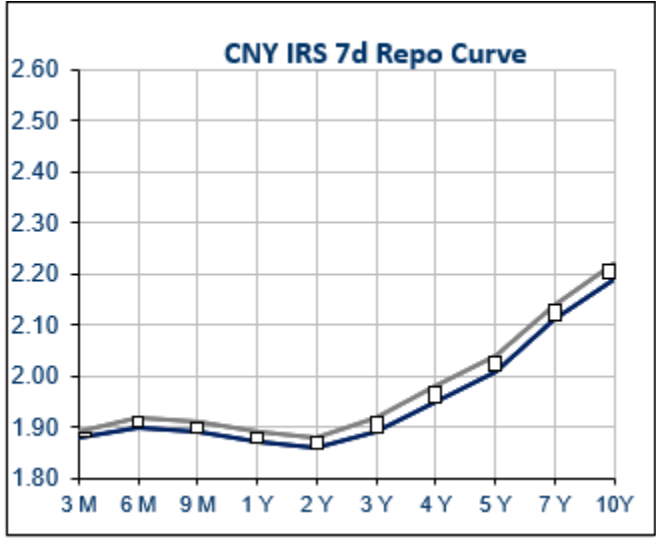
2024/7/9 Tuesday

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	1.88	-1				3 M	1.7	-									
6 M	1.9	-2	6 M	1.93	-2	6 M	1.71	-1									
9 M	1.89	-2	9 M	1.96	-2	9 M	1.7	-1									
1 Y	1.87	-2	1 Y	1.96	-2	1 Y	1.7	-				1Y	1.87	-2			
2 Y	1.86	-2	2 Y	1.95	-2	2 Y	1.69	-1	2 Y	1.65	-	2Y	1.85	-2			
3 Y	1.89	-3	3 Y	1.98	-4	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.87	-3			
4 Y	1.95	-3	4 Y	2.04	-3				4 Y	1.8	-	4Y	1.93	-2			
5 Y	2.01	-3	5 Y	2.11	-3				5 Y	1.8	-	5Y	1.97	-4			
7 Y	2.11	-3	7 Y	2.22	-3				7 Y	1.8	-						
10Y	2.19	-3	10Y	2.31	-3				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.87	-	3M Shibor	1.907	-	0-N Shibor	1.679	-7.50	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	2	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-1	-	3	-				
9M*1Y	-2	-	0	-	6M	3	-	
1*2Y	-1	-	-1	-	9M	7	-	
1*3Y	2	-1	2	-2	1Y	9	-	
1*4Y	8	-1	8	-1	2Y	9	-	
1*5Y	14	-1	15	-1	3Y	9	-1	
2*3Y	3	-1	3	-2	4Y	9	-	
2*4Y	9	-1	9	-1	5Y	10	-	
2*5Y	15	-1	16	-1				
3*4Y	6	-	6	1				
3*5Y	12	-	13	1				
4*5Y	6	-	7	-				
5*7Y	10	-	11	-				
5*10Y	18	-	20	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	45	42	38	36	35	34
今日	48	45	43	39	37	36	35

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	26	1	34
今日	-2	27	2	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金融工具、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