



【2024-06-12】

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：1.83%，与上一交易日持平，3m shibor fixing: 1.943%，与上一交易日下降 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.005%附近，后震荡成交在 2.005%-2.01%区间附近，午盘报收 01.00/00.50。中午回来，5y repo 小幅上行，震荡成交在 2.01%-2.02%附近，报收 01.75/01.5。1y repo 全天震荡成交在 1.8225%-1.84%区间附近，尾盘报收 84/83.5。其他期限，9m repo 成交在 1.8325%-1.8475%区间附近，2y repo 成交在 1.8375%-1.84%附近，3y repo 成交在 1.87%-1.88%%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 00.25bp 附近，9mx1y 成交在-01 到-00.75bp 附近，1x2y repo 成交在 0.5bp 点位，1x3y repo 成交在 04.5bp，1x5y repo 成交在 18-18.25bp 点位，报收 18.25/17.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 97/96.75，5y shibor 报收 14.5/13.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 17.75/16.5。基差方面，1y basis 报收 13.25/12.75，5y basis 报收 12.75/12。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

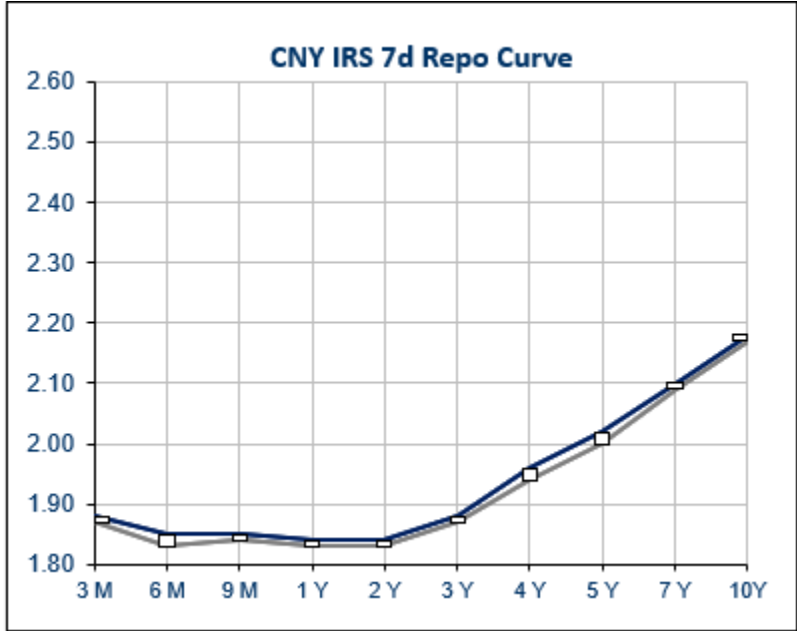
2024/6/12 Wednesday

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	1.88	1				3 M	1.68	1						
6 M	1.85	2	6 M	1.94	2	6 M	1.65	–						
9 M	1.85	1	9 M	1.99	2	9 M	1.67	1						
1 Y	1.84	1	1 Y	1.97	1	1 Y	1.62	1				1Y	1.84	2
2 Y	1.84	1	2 Y	1.96	1	2 Y	1.65	1	2 Y	1.65	–	2Y	1.84	2
3 Y	1.88	1	3 Y	2	1	3 Y	1.75	–	3 Y	1.77	–	3Y	1.87	2
4 Y	1.96	2	4 Y	2.07	1				4 Y	1.8	–	4Y	1.93	2
5 Y	2.02	2	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	1.83	–	3M Shibor	1.943	–0.40	0-N Shibor	1.68	0.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	-1	5	-			
9M*1Y	-1	-	-2	-1	6M	9	-
1*2Y	0	-	-1	-	9M	14	1
1*3Y	4	-	3	-	1Y	13	-
1*4Y	12	1	10	-	2Y	12	-
1*5Y	18	1	17	-	3Y	12	-
2*3Y	4	-	4	-	4Y	11	-1
2*4Y	12	1	11	-	5Y	12	-1
2*5Y	18	1	18	-			
3*4Y	8	1	7	-			
3*5Y	14	1	14	-			
4*5Y	6	-	7	-			
5*7Y	8	-1	11	-			
5*10Y	16	-1	20	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	41	37	35	34	32
今日	47	44	41	37	35	34	32

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	4	31	9	39
今日	3	29	7	38



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, 所有前述和保证均被明确放弃声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang