



【2024-06-27】

中国央行今日进行 1000 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。今日有 200 亿元逆回购到期，当日实现净投放 800 亿元。资金面上午偏紧，下午转均衡。7d repo fixing: 2.35%，与上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing: 1.9180%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.975%附近，后小幅震荡下行成交在 1.98%-1.9625%区间附近，午盘报收 96.5/96。中午回来，5y repo 继续小幅震荡，成交在 1.9675%-1.96%区间附近，报收 96/95.5。1y repo 全天震荡成交在 1.8325%-1.8225%区间附近，报收 83/82.5。其他期限，3m repo 成交在 1.8875%附近，6m repo 成交在 1.855%附近，9m repo 成交在 1.845%附近，2y repo 成交在 1.815%附近，3y repo 成交在 1.845%附近，4y repo 成交在 1.905%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-1bp 点位，1x2y repo 成交在-1.5bp 点位，2x3y repo 成交在 3bp 点位，4x5y repo 成交在 6.25bp 点位，1x5y repo 成交在 13bp 附近，报收 13/12.75。3mx6mx9m repo 成交在-2.25bp 点位。

Shibor 端，6m shibor 成交在 1.90%附近，9m shibor 成交在 1.93%附近，1y shibor 成交在 1.92%附近，报收 92.25/92，5y shibor 成交在 2.0625%附近，报收 06.5/06。曲线方面，9mx1y shibor 成交在-1bp 点位，1x5y shibor 报收 14.25/12.75。基差方面，1y basis 成交在 9-8.75bp 区间附近，报收 9.75/9.25，5y basis 成交在 10bp 点位，报收 10.5/9.5。

LPR 端，1y LPR_3y 成交在 3.355%，报收 36.5/35.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

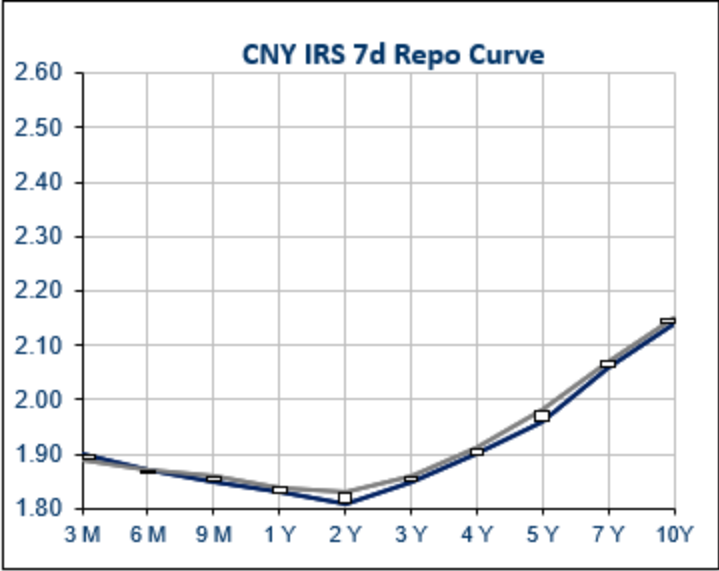
2024/6/27 Thursday

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	1.9	1				3 M	1.7	-2									
6 M	1.87	-	6 M	1.9	-1	6 M	1.69	-									
9 M	1.85	-1	9 M	1.94	-1	9 M	1.66	-2									
1 Y	1.83	-1	1 Y	1.93	-	1 Y	1.66	-2				1Y	1.82	-2			
2 Y	1.81	-2	2 Y	1.91	-1	2 Y	1.66	-1	2 Y	1.65	-	2Y	1.8	-1			
3 Y	1.85	-1	3 Y	1.94	-2	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.82	-2			
4 Y	1.9	-1	4 Y	2	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.87	-2			
5 Y	1.96	-2	5 Y	2.06	-2				5 Y	1.8	-	5Y	1.92	-2			
7 Y	2.06	-1	7 Y	2.17	-2				7 Y	1.8	-						
10Y	2.14	-1	10Y	2.27	-4				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.35	5.00	3M Shibor	1.918	-0.10	0-N Shibor	1.879	-9.70	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3 -1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-2 -1	4 -				
9M*1Y	-2 -	-1 1	6M	3	-1	
1*2Y	-2 -1	-2 -1	9M	9	-	
1*3Y	2 -	1 -2	1Y	10	1	
1*4Y	7 -	7 -2	2Y	10	1	
1*5Y	13 -1	13 -2	3Y	9	-1	
2*3Y	4 1	3 -1	4Y	10	-1	
2*4Y	9 1	9 -1	5Y	10	-	
2*5Y	15 -	15 -1				
3*4Y	5 -	6 -				
3*5Y	11 -1	12 -				
4*5Y	6 -1	6 -				
5*7Y	10 1	11 -				
5*10Y	18 1	21 -2				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	41	37	35	34	33
今日	47	43	41	37	36	34	33

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	0	28	3	36
今日	0	28	3	36



联系人: Ruby Hu
邮箱: ruby.hu@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, 其知识仅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。所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang