



【2024-07-08】

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。今日有 20 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.87%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 1.9070%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.045%附近，后震荡上行，成交到 2.06%位置，后震荡回调，成交在 2.06%-2.04%附近，午盘报收 04.25/04。中午回来，5y repo 成交在 2.0375%-2.045%区间附近，报收 04.25/04。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.9025%-1.885%区间附近，报收 89/88.75。其他期限，6m repo 成交在 1.91%-1.9125%附近，9m repo 成交在 1.90%-1.905%附近，2y repo 成交在 1.88%-1.895%附近，4y repo 成交在 1.98%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-1.5bp 附近，6x9x1 repo fly 成交在 0.5bp 附近，1x2y repo 成交在-0.5- -0.25bp 附近，2x5y repo 成交在 15.75bp 附近，1x2x5 repo fly 成交在-16.5bp 附近，1x5y repo 成交在 15.25-15.5bp 附近，报收 15.25/15。

Shibor 端，9m shibor 成交在 1.98%附近，1y shibor 成交在 1.975%-1.98%附近，报收 97.75/97.25，2y shibor 成交在 1.975%附近，5y shibor 报收 14.5/14。曲线方面，9mx1y shibor 成交在-0.25-00bp 附近，1x2y shibor 成交在-0.5bp 附近，1x5y shibor 报收 16.75/16.25。基差方面，1y basis 成交在 09bp 附近，报收 9/8.5，5y basis 报收 10.25/10。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

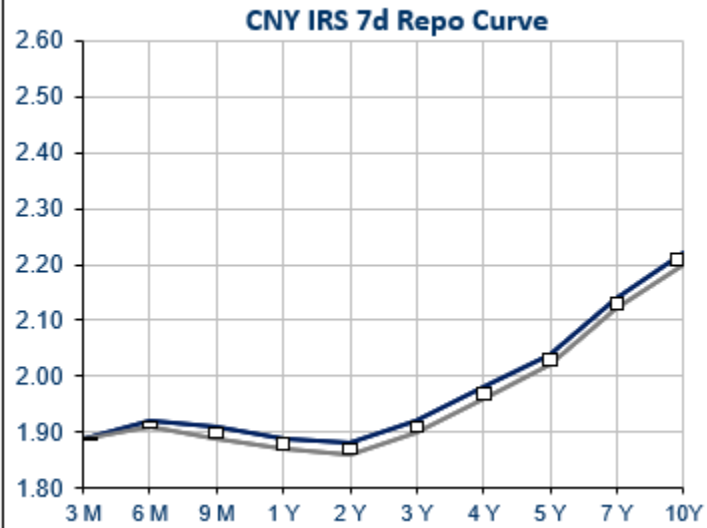
2024/7/8 Monday

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	1.89	-				3 M	1.7	-									
6 M	1.92	1	6 M	1.95	2	6 M	1.72	1									
9 M	1.91	2	9 M	1.98	-	9 M	1.71	3									
1 Y	1.89	2	1 Y	1.98	2	1 Y	1.7	2				1Y	1.89	2			
2 Y	1.88	2	2 Y	1.97	1	2 Y	1.7	1	2 Y	1.65	-	2Y	1.87	2			
3 Y	1.92	2	3 Y	2.02	3	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.9	2			
4 Y	1.98	2	4 Y	2.07	2				4 Y	1.8	-	4Y	1.95	2			
5 Y	2.04	2	5 Y	2.14	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.01	3			
7 Y	2.14	2	7 Y	2.25	3				7 Y	1.8	-						
10Y	2.22	2	10Y	2.34	3				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.87	2.00	3M Shibor	1.907	-0.10	0-N Shibor	1.754	-1	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	3	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-1	1	3	-2				
9M*1Y	-2	-	0	2	6M	3	1	
1*2Y	-1	-	-1	-1	9M	7	-2	
1*3Y	3	-	4	1	1Y	9	-	
1*4Y	9	-	9	-	2Y	9	-1	
1*5Y	15	-	16	-	3Y	10	1	
2*3Y	4	-	5	2	4Y	9	-	
2*4Y	10	-	10	1	5Y	10	-	
2*5Y	16	-	17	1				
3*4Y	6	-	5	-1				
3*5Y	12	-	12	-1				
4*5Y	6	-	7	-				
5*7Y	10	-	11	1				
5*10Y	18	-	20	1				

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-4	26	0	34
今日	-2	26	1	34



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投资建议、投资建议或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