



【2024-07-16】

中国央行今日进行 6760 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，作当日实现净投放 6740 亿元。资金面整体偏紧。7d repo fixing: 1.92%，与上一交易日上升 7bp，3m shibor fixing: 1.8970%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.98%附近，后震荡成交在 1.9725%-1.98%附近，午盘快速上行至 2.00%，午盘报收 99.25/99。中午回来，5y repo 成交在 1.99%-1.9825%区间附近，报收 98.5/98.25。1y repo 震荡成交在 1.845%-1.86%区间附近，报收 85.25/85。其他期限，6m repo 成交在 1.885%-1.895%附近，9m repo 成交在 1.875%附近，2y repo 成交在 1.85%附近，3y repo 成交在 1.8725%-1.8825%附近，4y repo 成交在 1.92%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在 01.5bp 附近，6x1 repo 成交在-4bp 附近，1x3y repo 成交在 2.5bp 附近，3x5y repo 成交在 10.5bp 附近，4x5y repo 成交在 05.75bp-06.25bp 附近，1x5y repo 成交在 13bp-13.25bp 附近，报收 13.5/13。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.9225%-1.93%附近，报收 92.75/92.25，5y shibor 成交在 2.055%-2.0625%附近，报收 06/05.5。曲线方面，9mx1y shibor 成交在 00bp 附近，1x5y shibor 成交在 13.25bp 附近，报收 13.5/13。基差方面，1y basis 成交在 7.5bp 附近，报收 7.5/7.25，5y basis 成交在 07.5bp 附近，报收 07.75/07.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

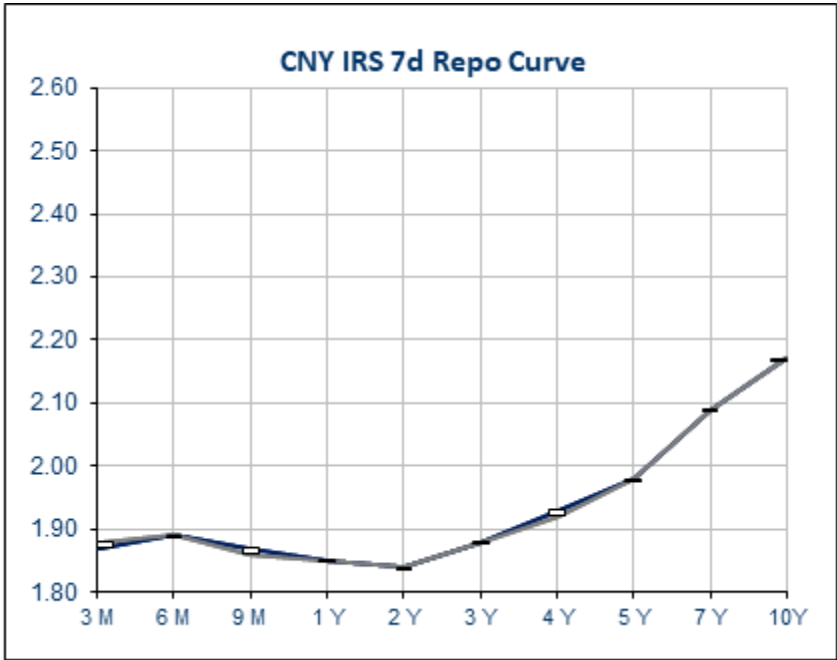
2024/7/16 星期二

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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1.87	-1				3 M	1.75	5						
6 M	1.89	-	6 M	1.9	-	6 M	1.75	5						
9 M	1.87	1	9 M	1.93	-	9 M	1.75	5						
1 Y	1.85	-	1 Y	1.92	-	1 Y	1.75	-				1Y	1.85	1
2 Y	1.84	-	2 Y	1.91	-	2 Y	1.75	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.83	-
3 Y	1.88	-	3 Y	1.94	1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.85	-
4 Y	1.93	1	4 Y	2	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.9	1
5 Y	1.98	-	5 Y	2.06	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.95	1
7 Y	2.09	-	7 Y	2.21	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.17	-	10Y	2.32	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.92	7.00	3M Shibor	1.897	-	O-N Shibor	1.894	11.40	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	2	1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	-2	1	3	-			
9M*1Y	-2	-1	-1	-	6M	1	-
1*2Y	-1	-	-1	-	9M	6	-1
1*3Y	3	-	2	1	1Y	7	-
1*4Y	8	1	8	-	2Y	7	-
1*5Y	13	-	14	-	3Y	6	1
2*3Y	4	-	3	1	4Y	7	-1
2*4Y	9	1	9	-	5Y	8	-
2*5Y	14	-	15	-			
3*4Y	5	1	6	-1			
3*5Y	10	-	12	-1			
4*5Y	5	-1	6	-			
5*7Y	11	-	15	-			
5*10Y	19	-	26	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	43	40	36	34	33	32
今日	47	43	40	36	35	34	33

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	28	2	35
今日	-3	28	2	34



联系人：Ruby Hu
邮箱：xiaoting.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：
以上所发及网站的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，并非投资建议/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、投资者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，也不保证其准确性、及时性或及时性等要求，且可能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