



【2024-07-11】

中国央行今日开展 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。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.83%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.9040%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.00%附近，后震荡下行，成交在 2.00%-1.995%附近，午盘报收 00/99.75。中午回来，5y repo 继续小幅下行，成交在 1.995%-1.99%区间附近，报收 99.25/99。1y repo 全天震荡成交在 1.8575%-1.85%区间附近，报收 85.25/85。其他期限，6m repo 成交在 1.89%附近，9m repo 成交在 1.8725%-1.875%附近，2y repo 成交在 1.845%-1.8475%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-1.5bp 点位，1x5y repo 成交 14bp 点位，报收 14.25/13.75。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.935%附近，报收 94/93.5，5y shibor 成交在 2.0925%-2.08%附近，报收 08.25/07.75。曲线方面，1x5y shibor 成交 14.5，报收 14.75/13.75。基差方面，1y basis 报收 9/8.25，5y basis 成交在 09.25bp-08.75bp，报收 09/08.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

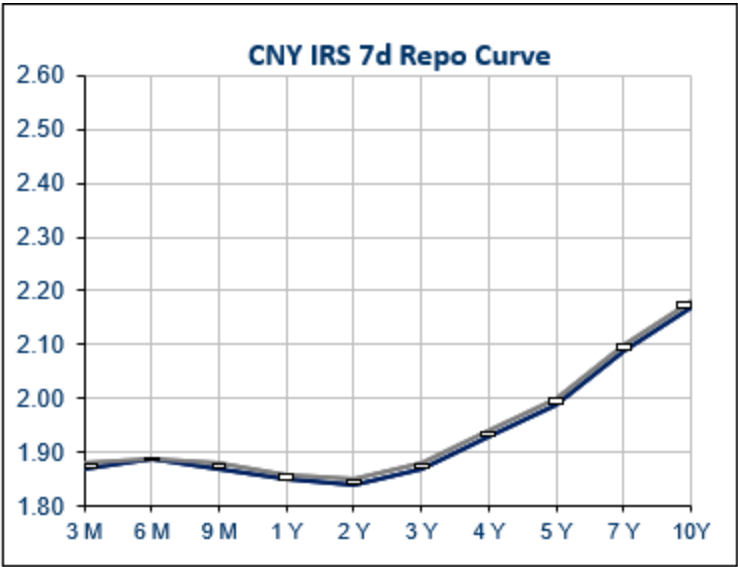
2024/7/11 Thursday

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	1.87	-1				3 M	1.7	-						
6 M	1.89	-	6 M	1.9	-2	6 M	1.7	-						
9 M	1.87	-1	9 M	1.94	-1	9 M	1.7	-						
1 Y	1.85	-1	1 Y	1.94	-	1 Y	1.74	5				1Y	1.85	-1
2 Y	1.84	-1	2 Y	1.93	-1	2 Y	1.73	5	2 Y	1.65	-	2Y	1.83	-1
3 Y	1.87	-1	3 Y	1.95	-2	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.85	-1
4 Y	1.93	-1	4 Y	2.01	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.91	-1
5 Y	1.99	-1	5 Y	2.08	-2				5 Y	1.8	-	5Y	1.95	-1
7 Y	2.09	-1	7 Y	2.19	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.17	-1	10Y	2.29	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.83	-2.00	3M Shibor	1.904	-0.20	0-N Shibor	1.67	3.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	2	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-2	-1	4	1				
9M*1Y	-2	-	0	1	6M	1	-2	
1*2Y	-1	-	-1	-1	9M	7	-	
1*3Y	2	-	1	-2	1Y	9	1	
1*4Y	8	-	7	-2	2Y	9	-	
1*5Y	14	-	14	-2	3Y	8	-1	
2*3Y	3	-	2	-1	4Y	8	-1	
2*4Y	9	-	8	-1	5Y	9	-1	
2*5Y	15	-	15	-1				
3*4Y	6	-	6	-				
3*5Y	12	-	13	-				
4*5Y	6	-	7	-				
5*7Y	10	-	11	1				
5*10Y	18	-	21	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	48	45	43	39	37	36	35
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	-1	28	2	36
今日	-1	28	3	36



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, 所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang