



【2024-06-20】

中国人民银行今日进行 200 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。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 1bp，3m shibor fixing: 1.9270%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.00%附近，后震荡成交在 2.005%-1.995%附近，午盘报收 99.75/99.5。中午回来，5y repo 继续小幅震荡，成交在 2.00%-1.995%区间附近，报收 00.25/99.75。1y repo 全天震荡成交在 1.8475%-1.835%区间附近，尾盘报收 84.5/84。其他期限，1m repo 成交在 1.925%-1.92%区间附近，3m repo 成交在 1.89%-1.9025%区间附近，6m repo 成交在 1.865%附近，9m repo 成交在 1.855%附近，3y repo 成交在 1.8725%-1.87%区间附近，4y repo 成交在 1.9325%附近。曲线方面，1mx3m repo 成交在-3bp 点位，3mx6m repo 成交在-3~-3.25bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-1.5bp 点位，3x4y repo 成交在 6.25bp 点位，1x5y repo 成交在 15.75bp 点位，报收 16/15.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 95.5/94.5，5y shibor 报收 12.25/11.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 17.75/15.75。基差方面，1y basis 报收 11.25/10，5y basis 报收 12.25/11.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

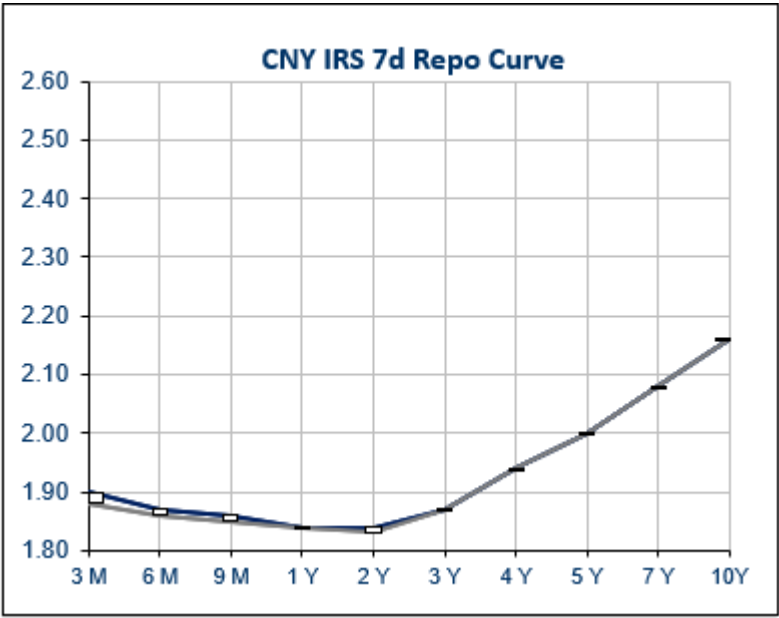
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/6/20 Thursday

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	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.9	2				3 M	1.69	-									
6 M	1.87	1	6 M	1.92	1	6 M	1.67	-									
9 M	1.86	1	9 M	1.96	1	9 M	1.66	1									
1 Y	1.84	-	1 Y	1.95	1	1 Y	1.66	3				1Y	1.84	-			
2 Y	1.84	1	2 Y	1.94	1	2 Y	1.64	-1	2 Y	1.65	-	2Y	1.82	-			
3 Y	1.87	-	3 Y	1.99	1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.84	-1			
4 Y	1.94	-	4 Y	2.05	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.91	-			
5 Y	2	-	5 Y	2.12	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.96	-			
7 Y	2.08	-	7 Y	2.23	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.16	-	10Y	2.33	1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.90	-1.00	3M Shibor	1.927	-0.20	0-N Shibor	1.877	2.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-1	-	4	-				
9M*1Y	-2	-1	-1	-	6M	5	-	
1*2Y	0	1	-1	-	9M	10	-	
1*3Y	3	-	4	-	1Y	11	1	
1*4Y	10	-	10	-1	2Y	10	-	
1*5Y	16	-	17	-1	3Y	12	1	
2*3Y	3	-1	5	-	4Y	11	-	
2*4Y	10	-1	11	-1	5Y	12	-	
2*5Y	16	-1	18	-1				
3*4Y	7	-	6	-1				
3*5Y	13	-	13	-1				
4*5Y	6	-	7	-				
5*7Y	8	-	11	-				
5*10Y	16	-	21	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	42	38	36	35	33
今日	47	44	42	38	36	35	33

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	1	28	4	36
今日	2	28	5	36



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiating.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/或者专用的信息, 其知识/权益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”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