



【2024-06-28】

中国央行今日进行 500 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 100 亿元逆回购到期，当日实现净投放 400 亿元。资金面整体偏紧，尾盘转松。7d repo fixing: 2.3%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 1.9180%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.96%附近，小幅上行后回落，成交在 1.96%-1.97%区间附近，午盘报收 96.5/96.25。中午回来，5y repo 小幅震荡，成交在 1.965%-1.9575%区间附近，报收 96.75/96.5。1y repo 全天震荡成交在 1.83%-1.8375%区间附近，报收 83.75/83.5。其他期限，6m repo 成交在 1.8675%-1.87%附近，9m repo 成交在 1.8525%附近，2y repo 成交在 1.8175%附近，3y repo 成交在 1.8475%附近，4y repo 成交在 1.90%-1.9025%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在 -02bp 到 -02.25bp 点位，2x3y repo 成交在 03bp 点位，4x5y repo 成交在 06.25bp 点位，1x5y repo 成交在 13.25bp-12.75bp 附近，报收 13.25/12.75。6mx9mx1y repo 成交在 0.25bp 点位。

Shibor 端，1y shibor 报收 93.25/92.75，5y shibor 报收 07.5/06.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 14.75/13.25。基差方面，1y basis 报收 09.5/09.25，5y basis 报收 10.75/10。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

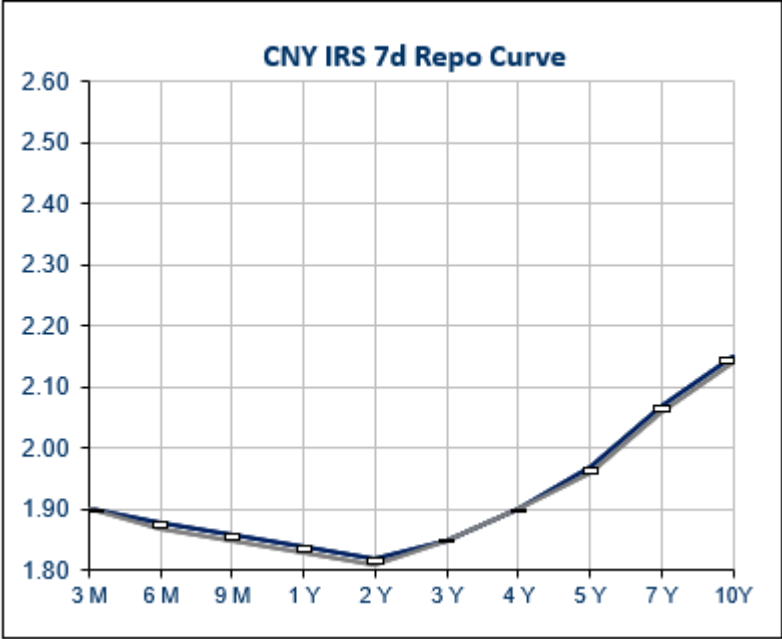
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/6/28 Friday

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	–				3 M	1.7	–						
6 M	1.88	1	6 M	1.9	–	6 M	1.69	–						
9 M	1.86	1	9 M	1.94	–	9 M	1.68	2						
1 Y	1.84	1	1 Y	1.93	–	1 Y	1.68	2				1Y	1.83	1
2 Y	1.82	1	2 Y	1.92	1	2 Y	1.67	1	2 Y	1.65	–	2Y	1.81	1
3 Y	1.85	–	3 Y	1.95	1	3 Y	1.75	–	3 Y	1.77	–	3Y	1.83	1
4 Y	1.9	–	4 Y	2.01	1				4 Y	1.8	–	4Y	1.88	1
5 Y	1.97	1	5 Y	2.07	1				5 Y	1.8	–	5Y	1.93	1
7 Y	2.07	1	7 Y	2.18	1				7 Y	1.8	–			
10Y	2.15	1	10Y	2.29	2				10Y	1.8	–			
7D REPO	2.30	-5.00	3M Shibor	1.918	–	0-N Shibor	1.889	1.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-2	–	4	–				
9M*1Y	-2	–	-1	–	6M	2	-1	
1*2Y	-2	–	-1	1	9M	8	-1	
1*3Y	1	-1	2	1	1Y	9	-1	
1*4Y	6	-1	8	1	2Y	10	–	
1*5Y	13	–	14	1	3Y	10	1	
2*3Y	3	-1	3	–	4Y	11	1	
2*4Y	8	-1	9	–	5Y	10	–	
2*5Y	15	–	15	–				
3*4Y	5	–	6	–				
3*5Y	12	1	12	–				
4*5Y	7	1	6	–				
5*7Y	10	–	11	–				
5*10Y	18	–	22	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	43	41	37	36	34	33
今日	47	44	42	38	36	35	34

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	0	28	3	36
今日	-1	27	3	35



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新证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国新证券”) 或其三方, “信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、股票或任何交易策略相关的推介、定价、建议或提示, “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