



【2024-07-24】

中国央行今日进行 661 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率持平 1.7%。今日有 2700 亿亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.85%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.8870%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.89%附近，后震荡成交在 1.89%-1.895%附近，午盘报收 89.25/89。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.89%-1.8825%区间附近，报收 89/88.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.7625%-1.7525%区间附近，报收 76.25/76。其他期限，6m repo 成交在 1.8075%-1.805%附近，9m repo 成交在 1.7775%附近，2y repo 成交在 1.7475%附近，3y repo 成交在 1.785%附近，4y repo 成交在 1.835%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-2.75bp 附近，3x5y repo 成交在 10.25-10.5bp 区间附近，6x9x1y repo fly 成交在-1- -0.5bp 附近，1x5y repo 成交在 13.25bp 附近，报收 13/12.5。

Shibor 端，1y shibor 报收 84.5/83.5，3y shibor 成交在 1.84%-1.835%附近，5y shibor 报收 96/95.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 12.5/11。基差方面，1y basis 报收 08.25/07.5，5y basis 报收 07/06.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

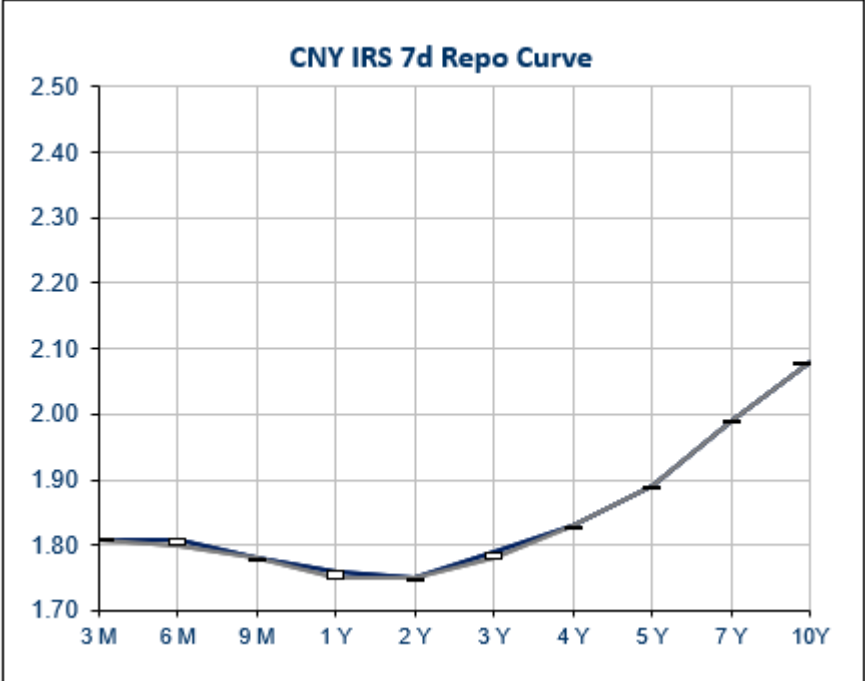
2024/7/24 Wednesday

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	1.81	-				3 M	1.75	-									
6 M	1.81	1	6 M	1.88	-	6 M	1.75	-									
9 M	1.78	-	9 M	1.85	-	9 M	1.75	-									
1 Y	1.76	1	1 Y	1.84	-	1 Y	1.75	-5				1Y	1.75	-			
2 Y	1.75	-	2 Y	1.82	-1	2 Y	1.75	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.73	-			
3 Y	1.79	1	3 Y	1.84	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.75	-			
4 Y	1.83	-	4 Y	1.9	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.8	-			
5 Y	1.89	-	5 Y	1.96	1				5 Y	1.8	-	5Y	1.85	-			
7 Y	1.99	-	7 Y	2.08	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.08	-	10Y	2.26	4				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.85	-	3M Shibor	1.887	-0.10	0-N Shibor	1.739	0.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	-1	-3	-				
9M*1Y	-2	1	-1	-	6M	7	-1	
1*2Y	-1	-1	-2	-1	9M	7	-	
1*3Y	3	-	0	-	1Y	8	-1	
1*4Y	7	-1	6	-	2Y	7	-1	
1*5Y	13	-1	12	1	3Y	5	-1	
2*3Y	4	1	2	1	4Y	7	-	
2*4Y	8	-	8	1	5Y	7	1	
2*5Y	14	-	14	2				
3*4Y	4	-1	6	-				
3*5Y	10	-1	12	1				
4*5Y	6	-	6	1				
5*7Y	10	-	12	-1				
5*10Y	19	-	30	3				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	37	34	32	26	23	22	21
今日	37	34	32	26	23	22	21

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-3	30	2	37
今日	-2	31	3	38



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:
以上所述及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的利/或者专用的信息。其知识产仅属于上海国联资产经纪有限公司 (以下简称“上海国联资产”) 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。所有陈述和保证均被明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang