



【2024-06-24】

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。因今日有 40 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 460 亿元。资金面上午偏紧，下午转松。7d repo fixing：2.35%，与上一交易日上升 32bp，3m shibor fixing: 1.9220%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.015%附近，随后小幅下行，震荡成交在 2.0175%-2.005%区间附近，午盘报收 00.75/00.5。中午回来，5y repo 小幅震荡下行，成交在 2.0125%-1.9975%区间附近，报收 99.75/99.5。1y repo 全天震荡成交在 1.8675%-1.855%区间附近，尾盘报收 85.75/85.25。其他期限，6m repo 成交在 1.8825%-1.8875%附近，9m repo 成交在 1.875%-1.88%附近，2y repo 成交在 1.8525%区间附近，3y repo 成交在 1.885%-1.8825%区间附近，4y repo 成交在 1.945%附近。曲线方面，6x9m repo 成交在-01bp 附近，9mx1y repo 成交在-01.5bp 到-01.75bp 区间附近，1x3y repo 成交在 02.25bp 附近，3x4y repo 成交在 06bp 附近，2x5y repo 成交在 15.25bp 区间附近，1x5y repo 报收 14.5/14。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 95/94.25，5y shibor 报收 10.75/10.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 16.5/15.25。基差方面，1y basis 报收 09.25/08.75，5y basis 报收 11/10.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

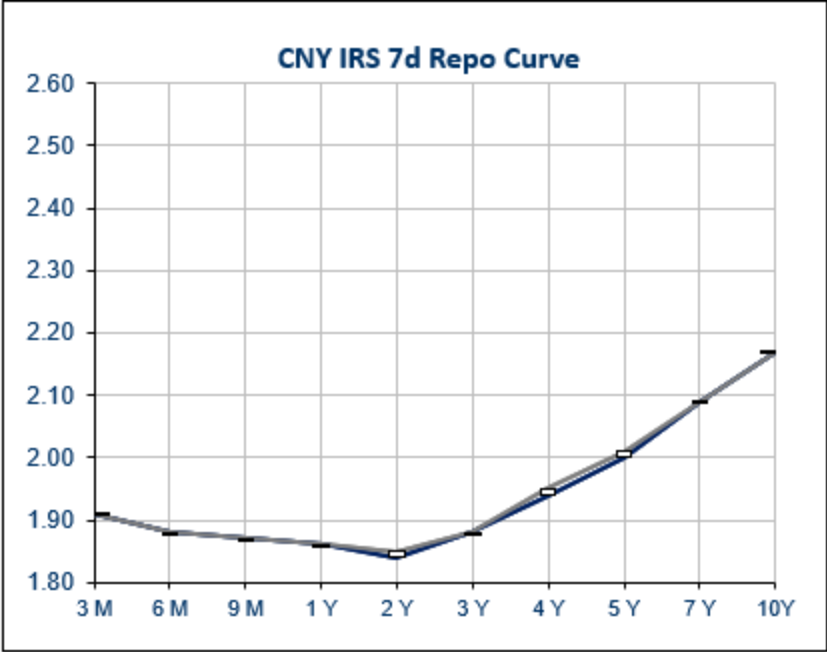
2024/6/24 Monday

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	1.91	—				3 M	1.75	5									
6 M	1.88	—	6 M	1.91	-1	6 M	1.69	2									
9 M	1.87	—	9 M	1.96	-1	9 M	1.67	1									
1 Y	1.86	—	1 Y	1.95	-1	1 Y	1.62	-2				1Y	1.85	—			
2 Y	1.84	-1	2 Y	1.93	-2	2 Y	1.65	—	2 Y	1.65	—	2Y	1.83	-1			
3 Y	1.88	—	3 Y	1.98	-1	3 Y	1.75	—	3 Y	1.77	—	3Y	1.85	-1			
4 Y	1.94	-1	4 Y	2.04	-1				4 Y	1.8	—	4Y	1.9	-2			
5 Y	2	-1	5 Y	2.1	-2				5 Y	1.8	—	5Y	1.96	-1			
7 Y	2.09	—	7 Y	2.23	—				7 Y	1.8	—						
10Y	2.17	—	10Y	2.33	—				10Y	1.8	—						
7D REPO	2.35	32.00	3M Shibor	1.922	-0.10	0-N Shibor	1.98	2.00	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	—			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-1	—	5	—				
9M*1Y	-1	—	-1	—	6M	3	-1	
1*2Y	-2	-1	-2	-1	9M	9	-1	
1*3Y	2	—	3	—	1Y	9	-1	
1*4Y	8	-1	9	—	2Y	9	-1	
1*5Y	14	-1	15	-1	3Y	10	-1	
2*3Y	4	1	5	1	4Y	10	1	
2*4Y	10	—	11	1	5Y	10	-1	
2*5Y	16	—	17	—				
3*4Y	6	-1	6	—				
3*5Y	12	-1	12	-1				
4*5Y	6	—	6	-1				
5*7Y	9	1	13	2				
5*10Y	17	1	23	2				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	41	37	35	34	33
今日	46	43	41	36	35	34	33

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	28	5	36
今日	1	28	4	35



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/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”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、及时性或准确性等需求, 且可未经通知而进行修改, 所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang