



【2024-06-14】

中国央行今日进行 20 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，当日实现零投放零回笼。资金面整体均衡，7d repo fixing: 1.83%，与上一交易日不变，3m shibor fixing:1.9390%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.0175%附近，后震荡成交在 2.015%-2.025%区间附近，午盘报收 02/01.5。中午回来，5y repo 小幅震荡下行，成交在 2.0225%-2.0075%附近，尾盘稍微回调，报收 01.5/01。1y repo 全天震荡成交在 1.85%-1.83%区间附近，尾盘报收 83.5/83。其他期限，9m repo 成交在 1.86%-1.8525%附近，2y repo 成交在 1.8475%附近，3y repo 成交在 1.89 %附近，4y repo 成交在 1.9575%附近。曲线方面，9mx1y 成交在-01- -01.25bp 附近，1x3y repo 成交在 04bp 附近，4x5y repo 成交在 6.25bp 附近，1x5y repo 报收 18/17.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.9725%附近，报收 96.25/95.25，5y shibor 报收 13.75/13。曲线方面，1x5y shibor 报收 17.5/16.75。基差方面，1y basis 成交 12.5bp, 报收 12.75/12.25，5y basis 报收 12.25/11.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

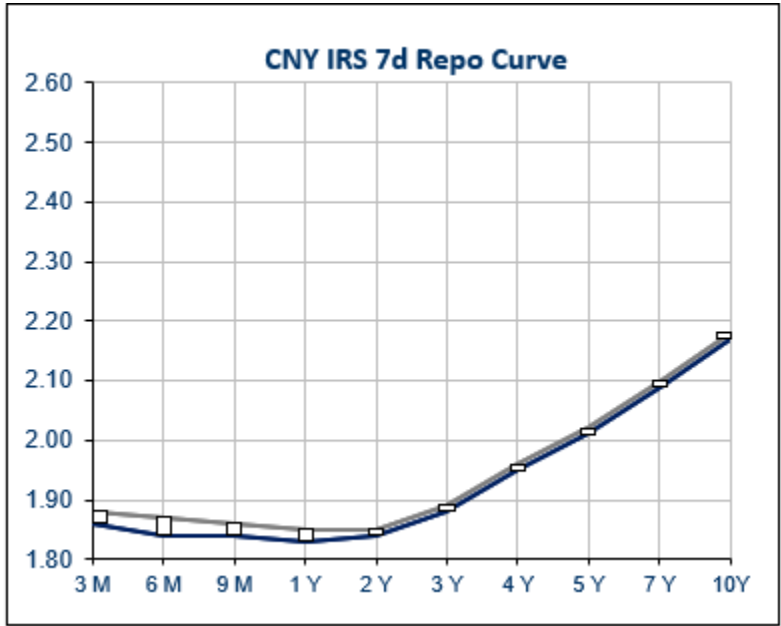
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/6/14 Friday

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	1.86	-2				3 M	1.68	-1						
6 M	1.84	-3	6 M	1.93	-1	6 M	1.65	-						
9 M	1.84	-2	9 M	1.97	-2	9 M	1.68	2						
1 Y	1.83	-2	1 Y	1.96	-2	1 Y	1.62	-				1Y	1.83	-2
2 Y	1.84	-1	2 Y	1.95	-1	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.83	-1
3 Y	1.88	-1	3 Y	2	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.85	-2
4 Y	1.95	-1	4 Y	2.07	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.91	-2
5 Y	2.01	-1	5 Y	2.13	-2				5 Y	1.8	-	5Y	1.97	-1
7 Y	2.09	-1	7 Y	2.24	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.17	-1	10Y	2.33	-2				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.83	-	3M Shibor	1.939	-0.10	0-N Shibor	1.732	0.90	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	1	4	-1				
9M*1Y	-1	-	-1	-	6M	9	2	
1*2Y	1	1	-1	1	9M	13	-	
1*3Y	5	1	4	1	1Y	13	-	
1*4Y	12	1	11	1	2Y	11	-	
1*5Y	18	1	17	-	3Y	12	-	
2*3Y	4	-	5	-	4Y	12	-	
2*4Y	11	-	12	-	5Y	12	-1	
2*5Y	17	-	18	-1				
3*4Y	7	-	7	-				
3*5Y	13	-	13	-1				
4*5Y	6	-	6	-1				
5*7Y	8	-	11	1				
5*10Y	16	-	20	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	42	37	35	34	32
今日	47	44	42	37	35	34	32

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	3	29	7	37
今日	3	29	8	37



联系人: Ruby Wu
邮箱: viaoting.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