



【2024-06-13】

中国央行今日开展 20 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 20 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现零投放零回笼。资金面整体均衡稍紧。7d repo fixing: 1.83%，与上一交易日持平，3m shibor fixing: 1.9400%，与上一交易日下降 0.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.01%附近，后震荡上行成交在 2.01%-2.025%区间附近，午盘报收 02.25/02。中午回来，5y repo 小幅震荡，成交在 2.015%-2.0225%附近，报收 02.75/02.25。1y repo 全天震荡上行成交在 1.8325%-1.85%区间附近，尾盘报收 85.25/84.75。其他期限，2y repo 成交在 1.8475%附近，3y repo 成交在 1.8825%-1.885%%附近。曲线方面，9mx1y 成交在 -01bp 附近，2x3y repo 成交在 03.75bp，1x5y repo 成交在 17.75-17.5bp 附近，报收 17.75/17.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 成交 1.97%附近，报收 97.75/97.25，5y shibor 报收 15/14.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 17.75/16.75。基差方面，1y basis 成交 12.5bp, 报收 13/12.5，5y basis 报收 12.5/12.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

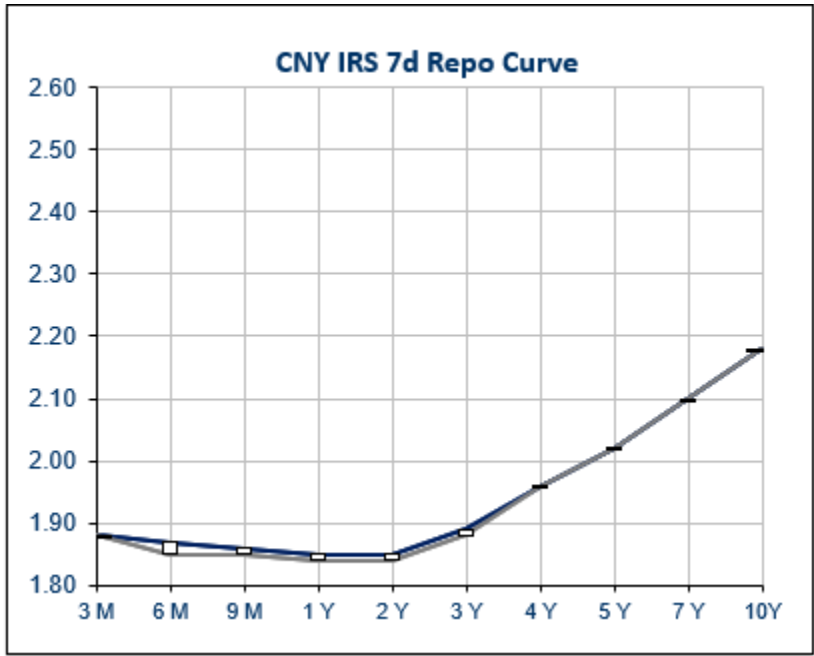
2024/6/13 Thursday

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	1.88	-				3 M	1.69	1						
6 M	1.87	2	6 M	1.94	-	6 M	1.65	-						
9 M	1.86	1	9 M	1.99	-	9 M	1.66	-1						
1 Y	1.85	1	1 Y	1.98	1	1 Y	1.62	-				1Y	1.85	1
2 Y	1.85	1	2 Y	1.96	-	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.84	-
3 Y	1.89	1	3 Y	2.01	1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.87	-
4 Y	1.96	-	4 Y	2.08	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.93	-
5 Y	2.02	-	5 Y	2.15	1				5 Y	1.8	-	5Y	1.98	-
7 Y	2.1	-	7 Y	2.25	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.18	-	10Y	2.35	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.83	-	3M Shibor	1.94	-0.30	0-N Shibor	1.723	4.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS			SHIBOR-REPO	
3M*6M	-1	2		Tenor	Mid	Δ bp		
6M*9M	-1	-1	5	-				
9M*1Y	-1	-	-1	1	6M	7	-2	
1*2Y	0	-	-2	-1	9M	13	-1	
1*3Y	4	-	3	-	1Y	13	-	
1*4Y	11	-1	10	-	2Y	11	-1	
1*5Y	17	-1	17	-	3Y	12	-	
2*3Y	4	-	5	1	4Y	12	1	
2*4Y	11	-1	12	1	5Y	13	1	
2*5Y	17	-1	19	1				
3*4Y	7	-1	7	-				
3*5Y	13	-1	14	-				
4*5Y	6	-	7	-				
5*7Y	8	-	10	-1				
5*10Y	16	-	20	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	41	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	38
今日	3	29	7	37



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting.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