



【2024-06-26】

中国央行今日进行 2500 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 2780 亿元逆回购到期。央行公开市场逆回购操作今日净回笼 280 亿元。资金面上午偏紧，下午转松。7d repo fixing: 2.3%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.9190%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.99%附近，后震荡成交在 1.99%-1.98%附近，午盘报收 98/97.75。中午回来，5y repo 继续小幅震荡，成交在 1.985%-1.975%区间附近，报收 97.75/97.25。1y repo 全天震荡成交在 1.8525%-1.845%区间附近，尾盘稍微震荡下行，成交在 1.8475%-1.8375%附近，报收 84/83.75。其他期限，6m repo 成交在 1.875%-1.8825%附近，9m repo 成交在 1.865%-1.87%附近，2y repo 成交在 1.835%附近，4y repo 成交在 1.92%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-1bp 点位，9mx1y repo 成交在-1.75~-2bp 区间附近，1x2y repo 成交在-1.5bp 点位，4x5y repo 成交在 6bp 点位，1x5y repo 成交在 13.25-13.5bp 区间附近，报收 14/13.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 93.5/92.5，5y shibor 报收 08.5/07.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 16/14。基差方面，1y basis 报收 9.5/8.75，5y 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

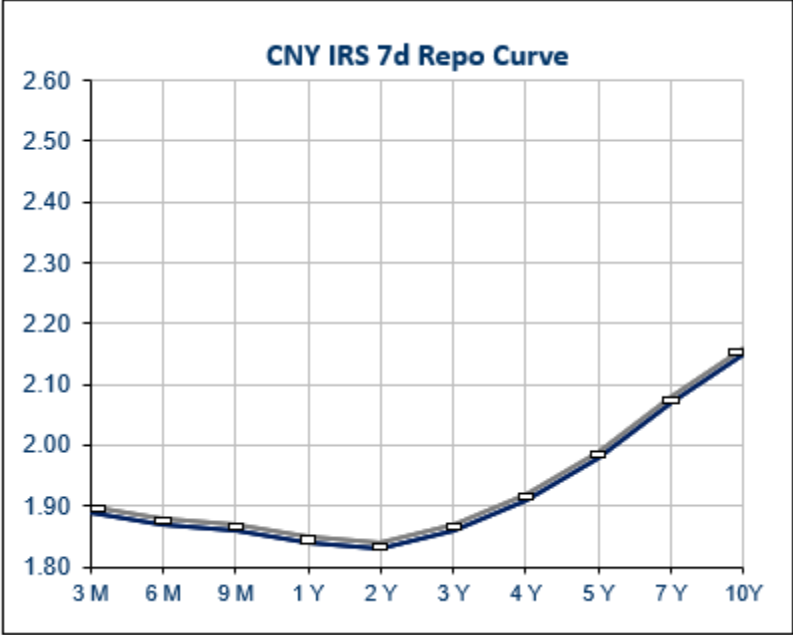
2024/6/26 Wednesday

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	1.89	-1				3 M	1.72	2							
6 M	1.87	-1	6 M	1.91	-	6 M	1.69	-1							
9 M	1.86	-1	9 M	1.95	-	9 M	1.68	-2							
1 Y	1.84	-1	1 Y	1.93	-1	1 Y	1.68	1				1Y	1.84	-	
2 Y	1.83	-1	2 Y	1.92	-1	2 Y	1.67	-3	2 Y	1.65	-	2Y	1.81	-1	
3 Y	1.86	-1	3 Y	1.96	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.84	-	
4 Y	1.91	-1	4 Y	2.02	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.89	-	
5 Y	1.98	-1	5 Y	2.08	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.94	-	
7 Y	2.07	-1	7 Y	2.19	-3				7 Y	1.8	-				
10Y	2.15	-1	10Y	2.31	-1				10Y	1.8	-				
7D REPO	2.30	-	3M Shibor	1.919	-0.20	0-N Shibor	1.976	1.20	1Y DEPO	1.50					

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

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	1	28	4	36
今日	0	28	3	36



联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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, 并非投资建议/或者有效的信息, 其知识仅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”) 或其三方, “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、建议或请求, “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