



【2024-06-19】

中国央行今日开展 2780 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，当日实现净投放 2760 亿元。资金面上午均衡稍紧，下午转松。7d repo fixing: 1.91%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 1.9290%，与上一交易日下降 0.5bp。

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 02/01.75。中午回来，5y repo 下行，成交在 2.015%-2.00%附近，报收 00/99.75。1y repo 全天震荡成交在 1.86%-1.835%区间附近，尾盘报收 84/83.5。其他期限，6m repo 成交在 1.8725%区间附近，9m repo 成交在 1.86%-1.87%区间附近，2y repo 成交在 1.84%-1.8575%附近，3y repo 成交 1.88%附近。曲线方面，9mx1y 成交在-01.5bp 附近，1x2y repo 成交在-0.25 附近，2x5y repo 成交在 16.25bp 点位，1x5y repo 成交在 16.5bp 至 16bp，报收 16.25/15.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 94.5/93.5，5y shibor 报收 12/11.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 18.25/17。基差方面，1y basis 成交 11.75，报收 11/10，5y basis 报收 12.25/11.5。

LPR 端，6m LPR_1Y 成交在 3.46%附近，尾盘报收 45.5/45，9m LPR_1Y 成交在 3.4425%附近，1y LPR_1Y 成交在 3.42%-3.41%附近，尾盘报收 41/40。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

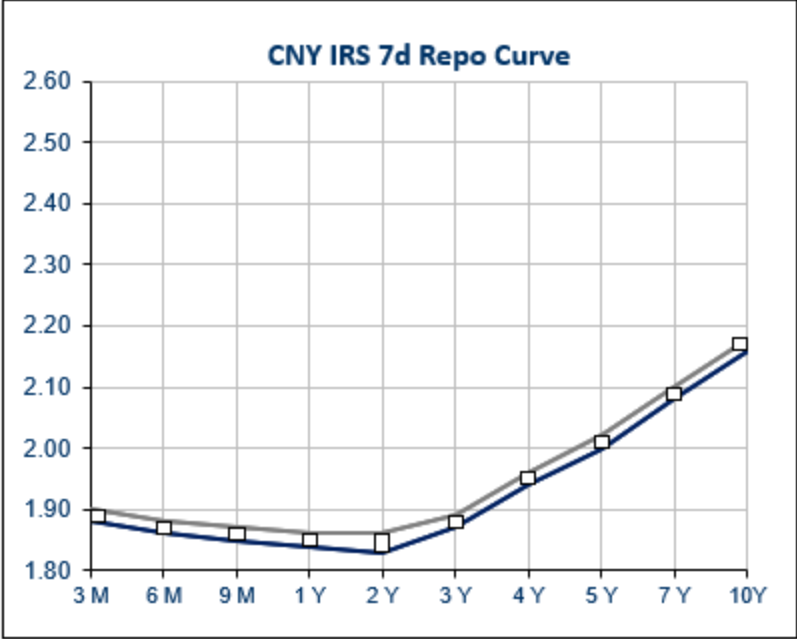
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/6/19 Wednesday

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	1.88	-2				3 M	1.69	-									
6 M	1.86	-2	6 M	1.91	-3	6 M	1.67	-									
9 M	1.85	-2	9 M	1.95	-3	9 M	1.65	-5									
1 Y	1.84	-2	1 Y	1.94	-3	1 Y	1.63	-1				1Y	1.84	-1			
2 Y	1.83	-3	2 Y	1.93	-3	2 Y	1.65	-1	2 Y	1.65	-	2Y	1.82	-2			
3 Y	1.87	-2	3 Y	1.98	-3	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.85	-1			
4 Y	1.94	-2	4 Y	2.05	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.91	-1			
5 Y	2	-2	5 Y	2.12	-2				5 Y	1.8	-	5Y	1.96	-2			
7 Y	2.08	-2	7 Y	2.23	-2				7 Y	1.8	-						
10Y	2.16	-2	10Y	2.32	-2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.91	2.00	3M Shibor	1.929	-0.50	0-N Shibor	1.853	2.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-1	-	4	-				
9M*1Y	-1	-	-1	-	6M	5	-1	
1*2Y	-1	-1	-1	-	9M	10	-1	
1*3Y	3	-	4	-	1Y	10	-1	
1*4Y	10	-	11	1	2Y	10	-	
1*5Y	16	-	18	1	3Y	11	-1	
2*3Y	4	1	5	-	4Y	11	-	
2*4Y	11	1	12	1	5Y	12	-	
2*5Y	17	1	19	1				
3*4Y	7	-	7	1				
3*5Y	13	-	14	1				
4*5Y	6	-	7	-				
5*7Y	8	-	11	-				
5*10Y	16	-	20	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	44	42	38	36	35	33
今日	47	44	42	38	36	35	33

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	27	6	35
今日	1	28	4	36



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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅供参考, 且为保密的、或有版权的信息, 其知识产权属于上海国新证券经纪有限公司 (以下简称“上海国新证券”) 或第三方。“信息”不应也不应被解释为任何投资建议、
投资建议或任何交易策略相关的推介、定价、建议或提示。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、及时性或完整性等要求, 且可未经通知而进行修改, 所有前述和保证均被明确地免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang