



【2024-09-24】

中国央行今日进行 4600 亿元 14 天期逆回购操作，中标利率为 1.85%，与此前持平。因今日无逆回购到期，当日实现净投放 4600 亿元。资金面均衡偏松。7d repo fixing: 2.05%，与上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing: 1.8500%，与上一交易日下降 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.66%附近，后震荡上行，成交在 1.64%-1.705%区间附近,午盘报收 70.25/69.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.695%-1.72%区间附近,报收 71.75/71.5。1y repo 全天震荡成交在 1.6575%-1.6925%区间附近，报收 66.75/66.25。其他期限，6m repo 成交在 1.7675%-1.775%区间附近，9m repo 成交在 1.715%附近，2y repo 成交在 1.615%-1.6325%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-6bp 点位，1x2y repo 成交在-5~-5.5bp 区间附近，2x5y repo 成交在 7bp 点位，1x5y repo 成交在 0.75-4.5bp 区间附近，报收 5.5/5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 成交在 1.72%，报收 72/71.5。5y shibor 报收 76.75/76。曲线方面，1x5y shibor 报收 5.25/4.25。基差方面,1y basis 报收 5.75/4.75，5y basis 报收 5.25/4.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

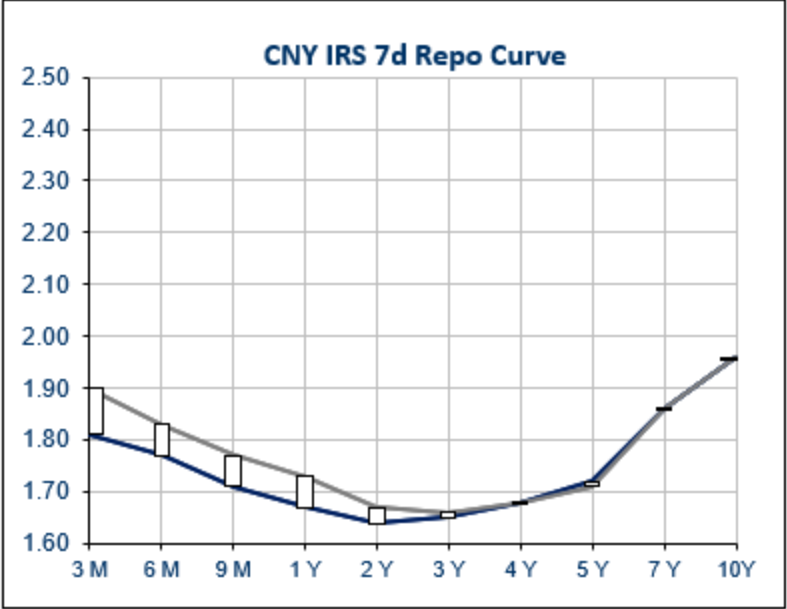
2024/9/24 星期二

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd												OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1. 81	-9				3 M	1. 6	-15									
6 M	1. 77	-6	6 M	1. 87	-4	6 M	1. 6	-15									
9 M	1. 71	-6	9 M	1. 77	-5	9 M	1. 6	-15									
1 Y	1. 67	-6	1 Y	1. 72	-6	1 Y	1. 6	-15				1Y	1. 66	-6			
2 Y	1. 64	-3	2 Y	1. 68	-3	2 Y	1. 6	-15	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 61	-3			
3 Y	1. 65	-1	3 Y	1. 7	-	3 Y	1. 6	-15	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 62	-			
4 Y	1. 68	-	4 Y	1. 73	1				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 66	-			
5 Y	1. 72	1	5 Y	1. 76	1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 67	1			
7 Y	1. 86	-	7 Y	1. 82	1				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 96	-	10Y	1. 89	1				10Y	1. 8	-						
7D REPO	2.05	5.00	3M Shibor	1. 85	-0.40	O-N Shibor	1.785	-13.60	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	3			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	-	-10	-1				
9M*1Y	-4	-	-5	-1	6M	10	2	
1*2Y	-3	3	-4	3	9M	6	1	
1*3Y	-2	5	-2	6	1Y	5	-	
1*4Y	1	6	1	7	2Y	4	-	
1*5Y	5	7	4	7	3Y	5	1	
2*3Y	1	2	2	3	4Y	5	1	
2*4Y	4	3	5	4	5Y	4	-	
2*5Y	8	4	8	4				
3*4Y	3	1	3	1				
3*5Y	7	2	6	1				
4*5Y	4	1	3	-				
5*7Y	14	-1	6	-				
5*10Y	24	-1	13	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	33	31	26	24	23	22
今日	36	33	31	26	24	23	22

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	32	11	41
今日	-1	34	10	43



联系人: Ruby Wu
邮箱: ruby@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、或者专用的信息。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”) 或第三方。”信息”不能也不应被解释为任何投资建议。投资者在任何交易决策相关的报价、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