



【2024-09-30】

中国央行今日进行 2121 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平。因今日有 1601 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 520 亿元。资金面上午偏紧，下午转松。7d repo fixing: 2.4000%，与上一交易日上升 60bp，3m shibor fixing: 1.840%，与上一交易日上升 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.8575%附近，后震荡成交在 1.88%-1.83%区间附近，午盘报收 83/82。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.87%-1.815%区间附近，报收 82.25/81.75。1y repo 全天震荡成交在 1.665%-1.6325%区间附近，报收 63.5/62.5。其他期限，2y repo 成交在 1.645%-1.64%区间附近。曲线方面，1x5y repo 成交在 21bp-19bp 区间附近，曲线走平，报收 19.25/18.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 70.5/69。5y shibor 报收 89.75/88.25。基差方面，1y basis 报收 7.5/6.5，5y basis 报收 7.5/6.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

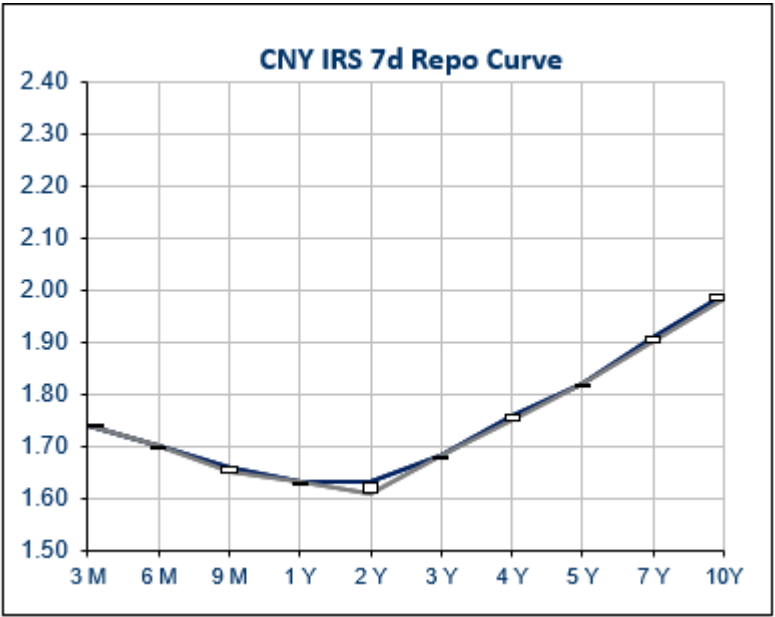
2024/9/30 星期一

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
3 M	1.74	-				3 M	1.6	-						
6 M	1.7	-	6 M	1.83	-1	6 M	1.6	-						
9 M	1.66	1	9 M	1.72	-2	9 M	1.55	-5						
1 Y	1.63	-	1 Y	1.7	-2	1 Y	1.55	-5				1Y	1.62	1
2 Y	1.63	2	2 Y	1.7	-4	2 Y	1.55	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.62	2
3 Y	1.68	-	3 Y	1.74	-7	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.67	-
4 Y	1.76	1	4 Y	1.81	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.75	1
5 Y	1.82	-	5 Y	1.89	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.8	2
7 Y	1.91	1	7 Y	1.94	-2				7 Y	1.8	-			
10Y	1.99	1	10Y	2.02	-2				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.40	60.00	3M Shibor	1.84	0.40	O-N Shibor	1.514	17.80	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-4	1	-11	-1				
9M*1Y	-3	-1	-2	-	6M	13	-1	
1*2Y	0	2	0	-2	9M	6	-3	
1*3Y	5	-	4	-5	1Y	7	-2	
1*4Y	13	1	11	2	2Y	7	-6	
1*5Y	19	-	19	1	3Y	6	-7	
2*3Y	5	-2	4	-3	4Y	5	-1	
2*4Y	13	-1	11	4	5Y	7	-1	
2*5Y	19	-2	19	3				
3*4Y	8	1	7	7				
3*5Y	14	-	15	6				
4*5Y	6	-1	8	-1				
5*7Y	9	1	5	-1				
5*10Y	17	1	13	-1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	26	21	17	12	10	9	8
今日	26	21	17	12	10	9	8

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-4	36	3	43
今日	0	34	7	42



联系人: Ruby Hu
邮箱: xiaoting.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:
以上所登及刊发的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的利/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国脉货币”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、股票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, 也不保证其完整性、时效性或准确性等要求, 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