



【2024-09-09】

中国央行公开市场开展 915 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率 1.70%，持平上次。今日有 35 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏紧，尾盘稍微转松。7d repo fixing: 1.93%，与上一交易日上升 3bp，3m shibor fixing: 1.85%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.745%附近，后震荡成交在 1.7425%-1.745%区间附近，午盘报收 74.5/74.25。中午回来，5y repo 小幅震荡下行，成交在 1.745%-1.7325%区间附近，报收 73.5/73.25。1y repo 全天震荡成交在 1.7075%-1.6975%区间附近，报收 70/69.75。其他期限，3m repo 成交在 1.835%附近，6m repo 成交在 1.80%附近，9m repo 成交在 1.7375%附近，2y repo 成交在 1.66%-1.665%附近，3y repo 成交在 1.68%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-6.25bp 附近，6mx1y repo 成交在-9.75bp 附近，1x2y repo 成交在-4bp 附近，2x5y repo 成交在 8.25bp 附近，1x5y repo 成交在 4-3.75bp 附近，报收 3.75/3.5。

Shibor 端，6m shibor 成交在 1.905%附近，1y shibor 成交在 1.795%-1.80%附近，报收 79.5/79，5y shibor 成交在 1.8225%附近，报收 82/80.75。曲线方面，1x5y shibor 成交在 2.75bp 附近，报收 3/1.5。基差方面，1y basis 报收 9.5/9.25，5y basis 报收 8.5/7.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

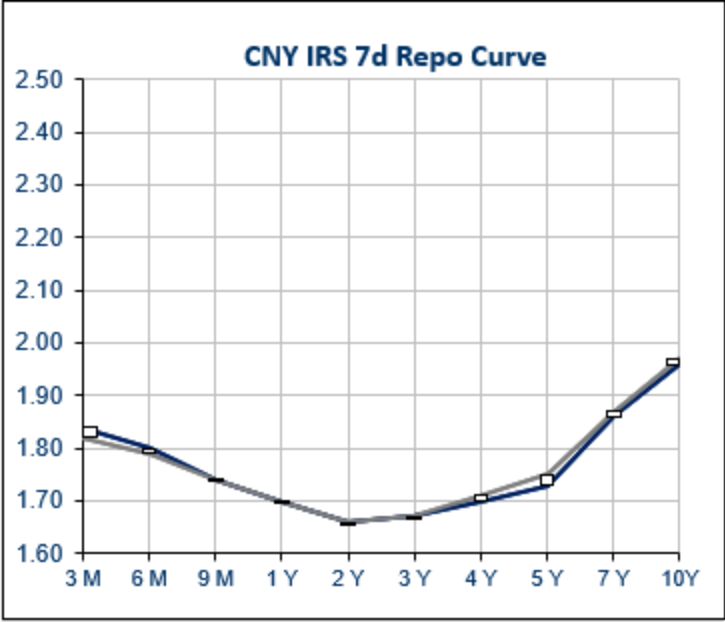
2024/9/9 Monday

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	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp			
3 M	1.84	2				3 M	1.75	-									
6 M	1.8	1	6 M	1.91	-	6 M	1.75	-									
9 M	1.74	-	9 M	1.84	-	9 M	1.75	-									
1 Y	1.7	-	1 Y	1.79	-	1 Y	1.75	-				1Y	1.69	-			
2 Y	1.66	-	2 Y	1.75	-1	2 Y	1.75	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.63	-1			
3 Y	1.67	-	3 Y	1.75	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.63	-1			
4 Y	1.7	-1	4 Y	1.78	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.67	-1			
5 Y	1.73	-2	5 Y	1.81	-2				5 Y	1.8	-	5Y	1.68	-2			
7 Y	1.86	-1	7 Y	1.9	-1				7 Y	1.8	-						
10Y	1.96	-1	10Y	1.99	-1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.93	3.00	3M Shibor	1.85	-	O-N Shibor	1.80	8.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-6	-1	-7	-				
9M*1Y	-4	-	-5	-	6M	11	-1	
1*2Y	-4	-	-4	-1	9M	10	-	
1*3Y	-3	-	-4	-1	1Y	9	-	
1*4Y	0	-1	-1	-1	2Y	9	-1	
1*5Y	3	-2	2	-2	3Y	8	-1	
2*3Y	1	-	0	-	4Y	8	-	
2*4Y	4	-1	3	-	5Y	8	-	
2*5Y	7	-2	6	-1				
3*4Y	3	-1	3	-				
3*5Y	6	-2	6	-1				
4*5Y	3	-1	3	-1				
5*7Y	13	1	9	1				
5*10Y	23	1	18	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	33	30	25	22	21	21
今日	36	33	30	25	22	21	21

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	37	12	47
今日	-1	37	13	47



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:
以上所述及附带的任何信息 (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际货币经纪有限公司 (以下简称“上海国际货币”) 或其三方。“信息”不应也不应被解释为与任何金融工具、投资策略有任何关系或相关的推介、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协议条款严格。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang