



【2024-09-25】

中国央行今日开展 1965 亿元 14 天期逆回购操作和 3000 亿元 1 年期 MLF 操作。因今日有 5682 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 717 亿元。其中，14 天期逆回购操作中标利率为 1.85%，与此前持平，MLF 中标利率 2.00%。7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 1.8450%，与上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.705%附近，后大幅下行，成交在 1.7175%-1.675%区间附近，午盘报收 68/67.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.6675%-1.655%区间附近，报收 65/64.5。1y repo 全天震荡成交在 1.6675%-1.6025%区间附近，报收 60.25/59.75。其他期限，6m repo 成交在 1.7175%-1.72%区间附近，9m repo 成交在 1.665%附近，2y repo 成交在 1.61%-1.6175%区间附近，3y repo 成交在 1.60%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-5.5bp 点位，1x2y repo 成交在-1.75bp 区间附近，1x5y repo 成交在 05-07bp 区间附近报收 04.75/04.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 65.25/63.25。5y shibor 报收 71.5/69.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 6.25/4.5。基差方面,1y basis 报收 05/03.5，5y basis 报收 06.5/05。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

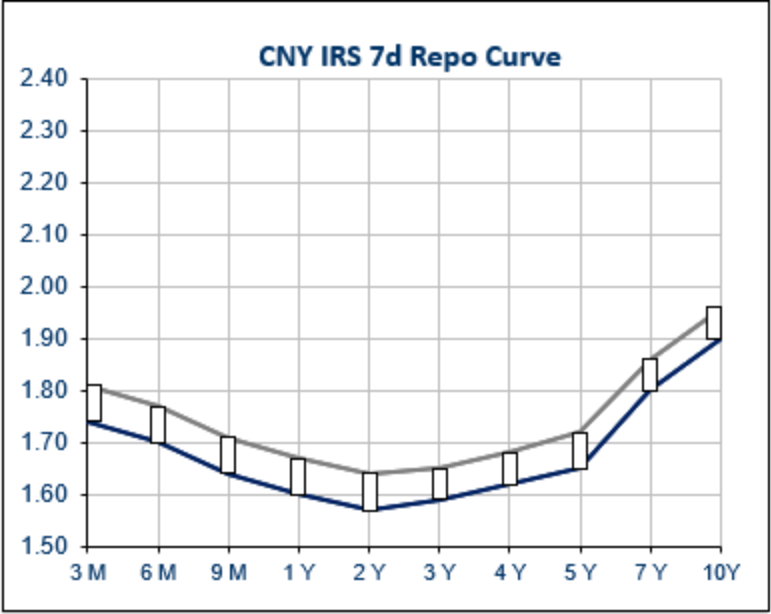
2024/9/25 星期三

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	-7				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 7	-7	6 M	1. 8	-7	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 64	-7	9 M	1. 7	-7	9 M	1. 6	-									
1 Y	1. 6	-7	1 Y	1. 65	-7	1 Y	1. 6	-				1Y	1. 59	-7			
2 Y	1. 57	-7	2 Y	1. 61	-7	2 Y	1. 55	-5	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 54	-7			
3 Y	1. 59	-6	3 Y	1. 63	-7	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 56	-6			
4 Y	1. 62	-6	4 Y	1. 66	-7				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 6	-6			
5 Y	1. 65	-7	5 Y	1. 71	-5				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 61	-6			
7 Y	1. 8	-6	7 Y	1. 76	-6				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 9	-6	10Y	1. 83	-6				10Y	1. 8	-						
7D REPO	2.00	-5.00	3M Shibor	1. 845	-0.50	O-N Shibor	1.643	-14.20	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS			SHIBOR-REPO	
3M*6M	-4	-			Tenor	Mid	Δbp		
6M*9M	-6	-	-10	-					
9M*1Y	-4	-	-5	-	6M	10	-		
1*2Y	-3	-	-4	-	9M	6	-		
1*3Y	-1	1	-2	-	1Y	5	-		
1*4Y	2	1	1	-	2Y	4	-		
1*5Y	5	-	6	2	3Y	4	-1		
2*3Y	2	1	2	-	4Y	4	-1		
2*4Y	5	1	5	-	5Y	6	2		
2*5Y	8	-	10	2					
3*4Y	3	-	3	-					
3*5Y	6	-1	8	2					
4*5Y	3	-1	5	2					
5*7Y	15	1	5	-1					
5*10Y	25	1	12	-1					

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	33	31	26	24	23	22
今日	28	28	20	18	16	15	14

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-1	34	10	43
今日	1	37	10	46



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, 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、建议或决策, 也不应作为决策依据。也不应作为决策依据。对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