



【2024-09-26】

中国央行今日开展 2920 亿元 14 天期逆回购操作。因今日有 5682 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2316 亿元。其中，14 天期逆回购操作中利率为 1.85%，与此前持平。7d repo fixing: 2.05%，与上一交易日上升 0.5bp，3m shibor fixing: 1.8360%，与上一交易日下降 0.9bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.645%附近，后震荡上行，成交在 1.645%-1.6675%区间附近，午盘报收 66.5/66。中午回来，5y repo 震荡上行成交在 1.6675%-1.70%区间附近，报收 70.5/70。1y repo 全天震荡成交在 1.5925%-1.62%区间附近，报收 61.5/61。其他期限，6m repo 成交在 1.6875%，9m repo 成交在 1.63%附近，2y repo 成交在 1.575%区间附近，3y repo 成交在 1.60%-1.605%附近。曲线方面，2x5y repo 成交在 11.25bp 区间附近，1x5y repo 成交在 04.25bp-07.5bp 区间，报收在 9/8.5，曲线走陡。

Shibor 端，2y shibor 成交在 1.6425%，其他成交清淡，1y shibor 报收 68.25/66.75。5y shibor 报收 77.25/76。曲线方面，1x5y shibor 报收 10/7.75。基差方面，1y basis 报收 07/06，5y basis 报收，07/05.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

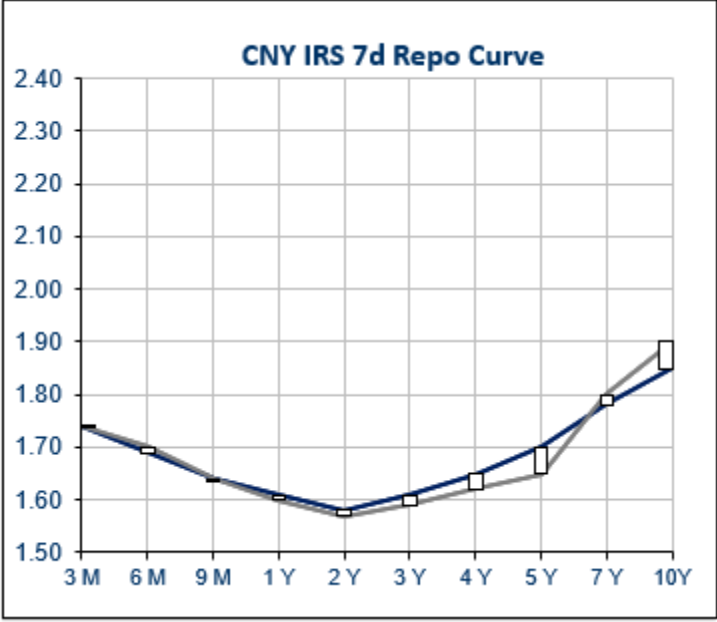
2024/9/26 星期四

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	1.74	-				3 M	1.75	15									
6 M	1.69	-1	6 M	1.8	-	6 M	1.75	15									
9 M	1.64	-	9 M	1.7	-	9 M	1.75	15									
1 Y	1.61	1	1 Y	1.68	3	1 Y	1.75	15				1Y	1.6	1			
2 Y	1.58	1	2 Y	1.66	5	2 Y	1.55	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.56	2			
3 Y	1.61	2	3 Y	1.66	3	3 Y	1.75	15	3 Y	1.77	-	3Y	1.59	3			
4 Y	1.65	3	4 Y	1.69	3				4 Y	1.8	-	4Y	1.64	4			
5 Y	1.7	5	5 Y	1.76	5				5 Y	1.8	-	5Y	1.66	5			
7 Y	1.78	-2	7 Y	1.79	3				7 Y	1.8	-						
10Y	1.85	-5	10Y	1.86	3				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.05	5.00	3M Shibor	1.836	-0.90	O-N Shibor	1.608	-3.50	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS			SHIBOR-REPO		
3M*6M	-5	-1		Tenor	Mid	Δbp			
6M*9M	-5	1	-10	-					
9M*1Y	-3	1	-2	3	6M	11	1		
1*2Y	-3	-	-2	2	9M	6	-		
1*3Y	0	1	-2	-	1Y	7	2		
1*4Y	4	2	1	-	2Y	8	4		
1*5Y	9	4	8	2	3Y	5	1		
2*3Y	3	1	0	-2	4Y	4	-		
2*4Y	7	2	3	-2	5Y	6	-		
2*5Y	12	4	10	-					
3*4Y	4	1	3	-					
3*5Y	9	3	10	2					
4*5Y	5	2	7	2					
5*7Y	8	-7	3	-2					
5*10Y	15	-10	10	-2					

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	28	28	20	18	16	15	14
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	1	37	10	46
今日	1	37	8	45



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:
以上所述及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或受专利的信息, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限公司 (以下简称“上海国脉货币”) 或其三方。“信息”不应也不应被解释为与任何金融工具、投资策略或任何交易策略相关的报价、定价、建议或推荐。“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, 且可未经通知地进行修改, 所有前述和保证均按协议条款声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang