



【2024-09-13】

中国央行公开市场开展 2362 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率 1.70%，持平上次。今日有 1415 亿元逆回购到期。资金面整体均衡，尾盘转松。7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing: 1.85%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.71%附近，后小幅震荡上行，成交在 1.7075%-1.7225%区间附近，午盘报收 72.5/72.25。中午回来，5y repo 小幅震荡回调，成交在 1.725%-1.7075%区间附近，报收 71.5/71。1y repo 全天震荡成交在 1.705%-1.7225%区间附近，报收 72.25/72。其他期限，6m repo 成交在 1.8225%-1.825%附近，9m repo 成交在 1.7625%附近，2y repo 成交在 1.6625%-1.6725%附近，7y repo 成交在 1.79%-1.7775%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-4bp 附近，6mx9m repo 成交在-6bp 附近，1x2y repo 成交在-5- -4.75bp 附近，2x5y repo 成交在 4.75bp 附近，5x7y repo 成交在 6.75-6.5bp 附近，1x5y repo 成交在 0.5-0bp 区间附近，曲线走平，报收-0.75/-1。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 79/78，5y shibor 报收 79/77。曲线方面，1x5y shibor 报收 0/-2。基差方面，1y basis 报收 7/6，5y basis 报收 8/6。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

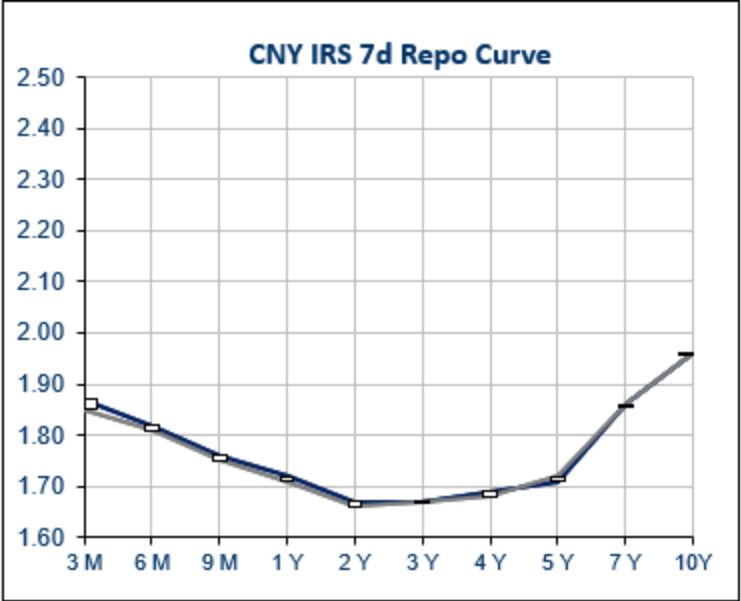
2024/9/13 Friday

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd												OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-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	1.87	2				3 M	1.75	-									
6 M	1.82	1	6 M	1.91	-	6 M	1.75	-									
9 M	1.76	1	9 M	1.84	-	9 M	1.75	-									
1 Y	1.72	1	1 Y	1.79	1	1 Y	1.75	-				1Y	1.7	1			
2 Y	1.67	1	2 Y	1.73	-1	2 Y	1.75	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.64	1			
3 Y	1.67	-	3 Y	1.72	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.63	-			
4 Y	1.69	1	4 Y	1.75	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.67	-			
5 Y	1.71	-1	5 Y	1.78	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.67	-			
7 Y	1.86	-	7 Y	1.85	-1				7 Y	1.8	-						
10Y	1.96	-	10Y	1.92	-3				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.95	5.00	3M Shibor	1.85	-	0-N Shibor	1.656	-12.10	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-5	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-6	-	-7	-				
9M*1Y	-4	-	-5	1	6M	9	-1	
1*2Y	-5	-	-6	-2	9M	8	-1	
1*3Y	-5	-1	-7	-1	1Y	7	-	
1*4Y	-3	-	-4	-2	2Y	6	-2	
1*5Y	-1	-2	-1	-2	3Y	5	-	
2*3Y	0	-1	-1	1	4Y	6	-2	
2*4Y	2	-	2	-	5Y	7	-	
2*5Y	4	-2	5	-				
3*4Y	2	1	3	-1				
3*5Y	4	-1	6	-1				
4*5Y	2	-2	3	-				
5*7Y	15	1	7	-				
5*10Y	25	1	14	-2				

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	-5	35	11	46
今日	-5	33	11	44



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:
以上所发及网站的所有信息 (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新证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国新证券”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资策略任何交易策略相关的推介、定价、建议或诱导。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其所提供、对准确性或及时性等要求, 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