



【2024-09-10】

中国央行今日进行 1860 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.70%，与此前持平。因今日有 12 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 1848 亿元。资金面上午偏紧，下午转松。7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 1.8510%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.735%附近，后震荡下行，成交在 1.715%-1.735%区间附近，午盘报收 71.25/71.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.71%-1.73%区间附近，报收 71.5/71。1y repo 全天震荡成交在 1.6875%-1.7025%区间附近，报收 70.25/70。其他期限，3m repo 成交在 1.835%-1.84%区间附近，6m repo 成交在 1.795%-1.8075%区间附近，9m repo 成交在 1.7325%-1.745%区间附近，2y repo 成交在 1.65%-1.6525%区间附近。曲线方面，6mx1y repo 成交在-10.75bp 点位，6mx9m repo 成交在-6.25bp 点位，9mx1y repo 成交在-4.5bp 点位，1x2y repo 成交在-4.25bp 点位，2x5y repo 成交在 6.5-6.75bp 区间附近，1x5y repo 成交在 1.75-3bp 区间附近，报收 1.5/0.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 80/78.25，5y shibor 成交在 1.80%附近，报收 80.25/78.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 1.75/0.75。基差方面，1y basis 报收 10/8.25，5y basis 报收 8.75/7.75。

LPR 端，1y LPR_2y 成交在 3.24%，报收 24/21.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

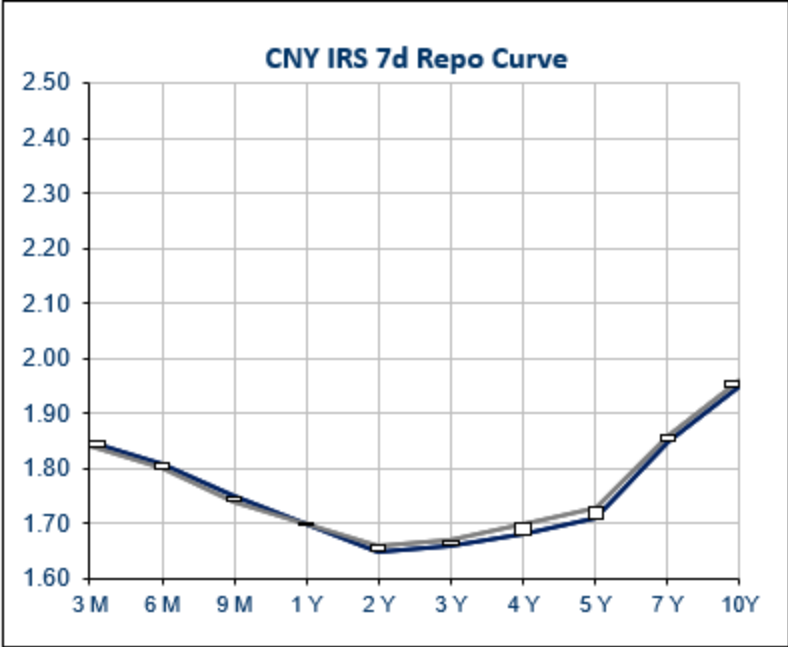
2024/9/10 Tuesday

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	1.85	1				3 M	1.75	-									
6 M	1.81	1	6 M	1.91	-	6 M	1.75	-									
9 M	1.75	1	9 M	1.84	-	9 M	1.73	-2									
1 Y	1.7	-	1 Y	1.8	1	1 Y	1.73	-2				1Y	1.68	-1			
2 Y	1.65	-1	2 Y	1.74	-1	2 Y	1.59	-16	2 Y	1.65	-	2Y	1.62	-1			
3 Y	1.66	-1	3 Y	1.74	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.61	-2			
4 Y	1.68	-2	4 Y	1.76	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.66	-1			
5 Y	1.71	-2	5 Y	1.8	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.66	-2			
7 Y	1.85	-1	7 Y	1.87	-3				7 Y	1.8	-						
10Y	1.95	-1	10Y	1.96	-3				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.95	2.00	3M Shibor	1.851	0.10	0-N Shibor	1.955	15.50	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-6	-	-7	-				
9M*1Y	-5	-1	-4	1	6M	10	-1	
1*2Y	-5	-1	-6	-2	9M	9	-1	
1*3Y	-4	-1	-6	-2	1Y	10	1	
1*4Y	-2	-2	-4	-3	2Y	9	-	
1*5Y	1	-2	0	-2	3Y	8	-	
2*3Y	1	-	0	-	4Y	8	-	
2*4Y	3	-1	2	-1	5Y	9	1	
2*5Y	6	-1	6	-				
3*4Y	2	-1	2	-1				
3*5Y	5	-1	6	-				
4*5Y	3	-	4	1				
5*7Y	14	1	7	-2				
5*10Y	24	1	16	-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	-1	37	13	47
今日	-3	38	14	48



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。其知识产属于上海国际市场经纪有限公司 (以下简称“上海国际”) 或其三方。“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报价、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、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