



【2024-09-19】

中国央行今日进行 5236 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 1608 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 3628 亿元。资金面上午紧张，下午偏紧，尾盘转松。7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日上升 10bp，3m shibor fixing: 1.8510%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.6925%附近，后震荡成交在 1.6925%-1.71%区间附近，午盘报收 70/69.75。中午回来，5y repo 小幅震荡成交在 1.705%-1.715%区间附近，报收 70.75/70.5。1y repo 全天震荡成交在 1.7275%-1.7075%区间附近，报收 72.25/72。其他期限，3m repo 成交在 1.875% 附近，6m repo 成交在 1.825%附近，9m repo 成交在 1.7575%区间附近，2y repo 成交在 1.66%-1.6625%附近。曲线方面，6mx9m 成交在-06.75bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-03.75bp 区间附近，1x2y repo 成交在-06~-05.75bp 区间附近，1x5y repo 成交在-01~-02.25bp 区间附近，报收-1.25/-1.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 79.5/79.25，5y shibor 报收 78/77.5。曲线方面，1x5y shibor 报收-1.25/-2。基差方面，1y basis 报收 07.5/07.25，5y basis 报收 07.5/07。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

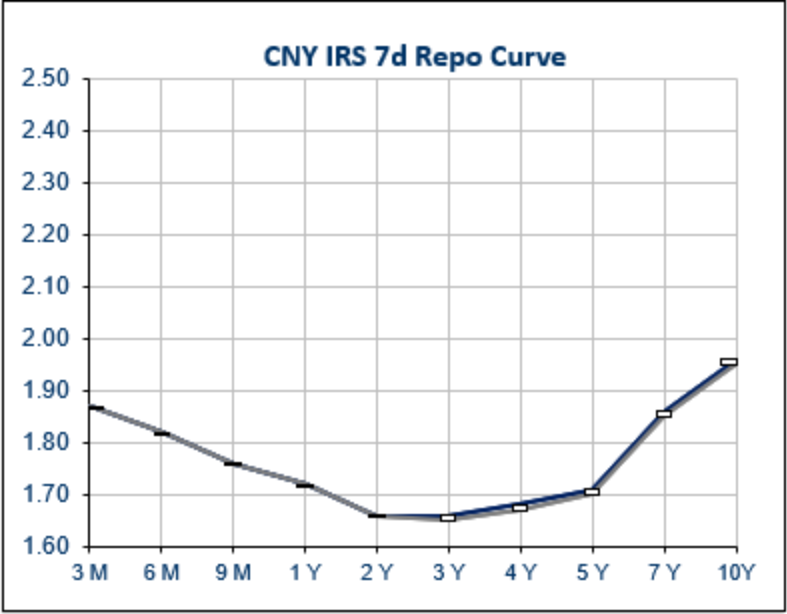
2024/9/19 Thursday

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	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.87	-				3 M	1.75	-									
6 M	1.82	-	6 M	1.92	1	6 M	1.75	-									
9 M	1.76	-	9 M	1.84	-	9 M	1.75	-									
1 Y	1.72	-	1 Y	1.79	-	1 Y	1.75	14				1Y	1.71	-			
2 Y	1.66	-	2 Y	1.74	-	2 Y	1.75	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.64	1			
3 Y	1.66	1	3 Y	1.73	1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.62	1			
4 Y	1.68	1	4 Y	1.75	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.66	1			
5 Y	1.71	1	5 Y	1.78	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.66	1			
7 Y	1.86	1	7 Y	1.84	-				7 Y	1.8	-						
10Y	1.96	1	10Y	1.92	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.00	10.00	3M Shibor	1.851	0.10	0-N Shibor	1.879	13.50	1Y DEPO	1.50							

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

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	33	30	25	22	21	21
今日	36	33	31	26	24	23	22

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-4	32	12	43
今日	-2	32	12	42



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiating.bu@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责任公司 (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。投资者在任何交易策略相关的报价、定价、建议或建议, “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。自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