



【2024-09-06】

中国央行今日进行 1415 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 301 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1114 亿元。资金面全天偏紧。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日上升 1bp, 3m shibor fixing: 1.85%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.765%附近，后震荡下行成交在 1.765 %-1.75%区间附近，午盘报收 75.25/75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.75%-1.7425%区间附近，报收 74.75/74.25。1y repo 早盘成交 1.705%，后全天震荡成交在 1.705%-1.69%区间附近，报收 69.75/69.5。其他期限，6m repo 成交在 1.785-1.7775%区间附近，2y repo 成交在 1.6625%-1.66%区间。曲线方面，6mx12m repo 成交在-8.75bp 附近，1x2y repo 成交在-3.75bp 附近，2x5y repo 成交在 8.75bp 区间，1x5y repo 成交在 6.25bp-4.5bp 附近，1x5y repo 报收 5.25/4.5，曲线走平。

Shibor 端，6m shibor 成交在 1.905%-1.90%附近，1y shibor 报收 79.75/79，5y shibor 报收 83.75/83。曲线方面，1x5y shibor 报收 4.75/4。基差方面，1y basis 报收 10.25/9.25，5y basis 报收 09/08.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

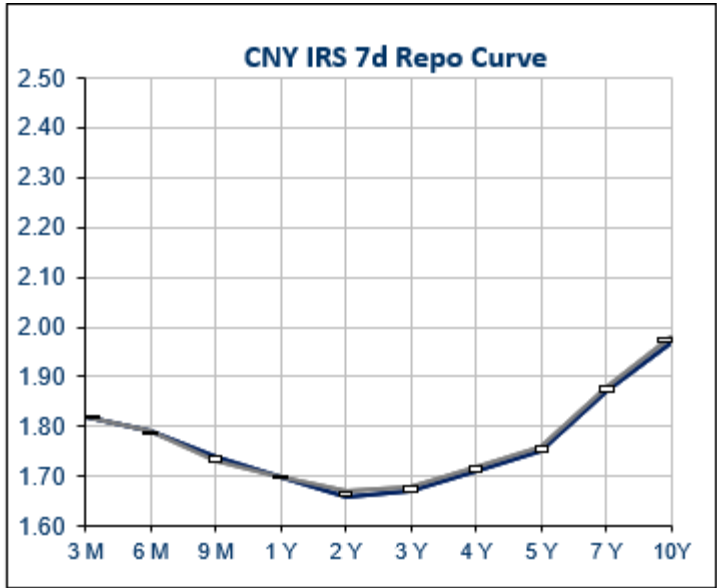
2024/9/6 Friday

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	1.82	-				3 M	1.75	-									
6 M	1.79	-	6 M	1.91	2	6 M	1.75	-									
9 M	1.74	1	9 M	1.84	-	9 M	1.75	-									
1 Y	1.7	-	1 Y	1.79	-	1 Y	1.75	-				1Y	1.69	-			
2 Y	1.66	-1	2 Y	1.76	-1	2 Y	1.75	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.64	1			
3 Y	1.67	-1	3 Y	1.76	-2	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.64	-			
4 Y	1.71	-1	4 Y	1.79	-3				4 Y	1.8	-	4Y	1.68	-			
5 Y	1.75	-1	5 Y	1.83	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.7	-1			
7 Y	1.87	-1	7 Y	1.91	-1				7 Y	1.8	-						
10Y	1.97	-1	10Y	2	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.90	1.00	3M Shibor	1.85	-	0-N Shibor	1.716	13.80	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
					Tenor	Mid	Δ bp	
3M*6M	-3	-						
6M*9M	-5	1	-7	-2				
9M*1Y	-4	-1	-5	-	6M	12	2	
1*2Y	-4	-1	-3	-1	9M	10	-1	
1*3Y	-3	-1	-3	-2	1Y	9	-	
1*4Y	1	-1	0	-3	2Y	10	-	
1*5Y	5	-1	4	-1	3Y	9	-1	
2*3Y	1	-	0	-1	4Y	8	-2	
2*4Y	5	-	3	-2	5Y	8	-	
2*5Y	9	-	7	-				
3*4Y	4	-	3	-1				
3*5Y	8	-	7	1				
4*5Y	4	-	4	2				
5*7Y	12	-	8	-				
5*10Y	22	-	17	1				

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	-2	36	11	46
今日	-2	37	12	47



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting.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:
以上所发及附发的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国际市场结构有限责任公司 (以下简称“上海国际”) 或第三方, “信息”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, 所有前述和保证均被明确放弃声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang