



【2024-09-05】

中国央行：今日进行 633 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.70%，与此前持平。今日有 1509 亿元 7 天期逆回购到期。当日实现净回笼 876 亿元。资金面整体偏紧。7d repo fixing: 1.89%，与上一交易日下降 1bp, 3m shibor fixing: 1.8500%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.75%附近，随后震荡成交在 1.7525%-1.7425%区间附近，午盘报收 74.5/74.25。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.755%-1.7375%区间附近，报收 75.5/75。1y repo 全天震荡成交在 1.72%-1.69%区间附近，报收 69.75/69.25。其他期限，3m repo 成交在 1.82%-1.825%附近，6m repo 成交在 1.795%-1.7975%区间附近，2y repo 成交在 1.6925%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在-3.75bp 到-3.5bp 点位，2x5y repo 成交在 8.25bp 点位，1x5y repo 成交在 03.75bp-5.75bp 附近，报收 06.25/05.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 79.5/78.5，5y shibor 报收 84.25/83.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 05.5/04.75。基差方面，1y basis 报收 10.25/09.25，5y basis 报收 08.75/07.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

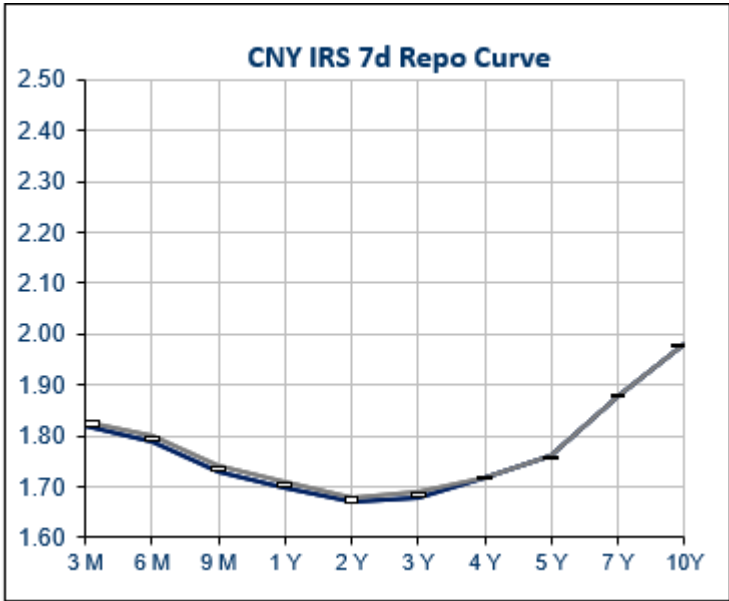
2024/9/5 Thursday

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
3 M	1.82	-1				3 M	1.75	9						
6 M	1.79	-1	6 M	1.89	-2	6 M	1.75	8						
9 M	1.73	-1	9 M	1.84	-1	9 M	1.75	8						
1 Y	1.7	-1	1 Y	1.79	-2	1 Y	1.75	12				1Y	1.69	-
2 Y	1.67	-1	2 Y	1.77	-1	2 Y	1.75	4	2 Y	1.65	-	2Y	1.63	-2
3 Y	1.68	-1	3 Y	1.78	-1	3 Y	1.75	2	3 Y	1.77	-	3Y	1.64	-2
4 Y	1.72	-	4 Y	1.82	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.68	-2
5 Y	1.76	-	5 Y	1.84	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.71	-1
7 Y	1.88	-	7 Y	1.92	-				7 Y	1.8	-			
10Y	1.98	-	10Y	2	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.89	-1.00	3M Shibor	1.85	-	0-N Shibor	1.578	4.90	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-6	-	-5	1				
9M*1Y	-3	-	-5	-1	6M	10	-1	
1*2Y	-3	-	-2	1	9M	11	-	
1*3Y	-2	-	-1	1	1Y	9	-1	
1*4Y	2	1	3	1	2Y	10	-	
1*5Y	6	1	5	2	3Y	10	-	
2*3Y	1	-	1	-	4Y	10	-1	
2*4Y	5	1	5	-	5Y	8	-	
2*5Y	9	1	7	1				
3*4Y	4	1	4	-				
3*5Y	8	1	6	1				
4*5Y	4	-	2	1				
5*7Y	12	-	8	-				
5*10Y	22	-	16	-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	-1	36	11	46
今日	-2	36	11	46



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“上海国际货币”) 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, 所有陈述和保证均被明确放弃声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang