



【2024-09-12】

中国央行今日进行 1608 亿 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.70%，与此前持平。因今日有 633 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 975 亿元。资金面均衡。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 4bp，3m shibor fixing: 1.85%，与上一交易日下降-0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.715%附近，后震荡上行，成交在 1.715%-1.725%区间附近，午盘报收 72.75/72.5。中午回来，5y repo 震荡上行成交在 1.725%-1.7325%区间附近，报收 72/71.5。1y repo 全天震荡成交在 1.715%-1.70%区间附近，报收 71.25/71。其他期限，3m repo 成交在 1.85%-1.8525%区间附近，6m repo 成交在 1.81%-1.8175%区间附近，9m repo 成交在 1.7525-1.755%区间附近，2y repo 成交在 1.66%附近，3y repo 成交在 1.66%-1.665%区间附近，4y repo 成交在 1.6825%区间附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在-3.75bp 点位，6mx9m repo 成交在-6~-6.25bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-4~-4.75bp 区间附近，1x5y repo 成交在 1.25bp 点位，报收 01/0.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 78.5/77.5，3y shibor 成交在 1.72%附近，5y shibor 报收 80/78.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 1.5/0。基差方面，1y basis 报收 7.5/6.5，5y basis 报收 8.5/6.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

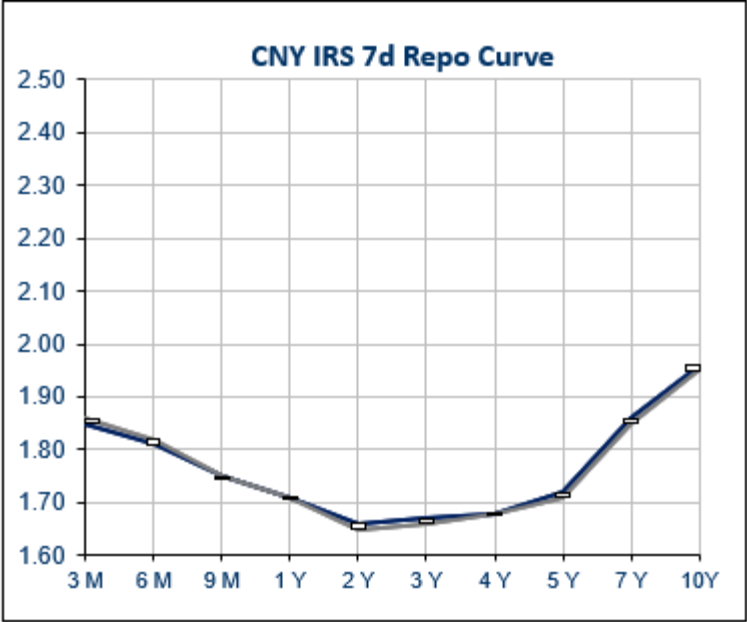
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/9/12 Thursday

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	1.85	-1				3 M	1.75	-						
6 M	1.81	-1	6 M	1.91	-	6 M	1.75	-						
9 M	1.75	-	9 M	1.84	1	9 M	1.75	-						
1 Y	1.71	-	1 Y	1.78	-1	1 Y	1.75	-				1Y	1.69	-
2 Y	1.66	1	2 Y	1.74	1	2 Y	1.75	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.63	1
3 Y	1.67	1	3 Y	1.72	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.63	1
4 Y	1.68	-	4 Y	1.76	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.67	1
5 Y	1.72	1	5 Y	1.79	1				5 Y	1.8	-	5Y	1.67	1
7 Y	1.86	1	7 Y	1.86	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	1.96	1	10Y	1.95	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-4.00	3M Shibor	1.85	-0.10	0-N Shibor	1.777	0.40	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-6	1	-7	1				
9M*1Y	-4	-	-6	-2	6M	10	1	
1*2Y	-5	1	-4	2	9M	9	1	
1*3Y	-4	1	-6	-	1Y	7	-1	
1*4Y	-3	-	-2	2	2Y	8	-	
1*5Y	1	1	1	2	3Y	5	-2	
2*3Y	1	-	-2	-2	4Y	8	1	
2*4Y	2	-1	2	-	5Y	7	-	
2*5Y	6	-	5	-				
3*4Y	1	-1	4	2				
3*5Y	5	-	7	2				
4*5Y	4	1	3	-				
5*7Y	14	-	7	-2				
5*10Y	24	-	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	-5	36	12	46
今日	-5	35	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:
以上所发及所加的所有信息 (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际货币经纪有限公司 (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, 也不保证其所提供、刊登性或者准确性等要求, 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