



【2024-08-29】

中国央行：今日进行 1509 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 3593 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2084 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.85%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.83%附近，后小幅震荡，成交在 1.83%-1.8425%区间附近，午盘报收 83.75/83.5。中午回来，5y repo 小幅震荡上行，成交在 1.8375%-1.845%区间附近，报收 84.25/84。1y repo 全天震荡成交在 1.7525%-1.7575%区间附近，报收 76/75.5。其他期限，6m repo 成交在 1.82%-1.825%区间附近，9m repo 成交在 1.7825%-1.7875%区间附近，2y repo 成交在 1.7375%-1.7425%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 -3.5bp~-3.75bp 区间附近，9mx1y repo 成交在 -2.75bp 点位，1x2y repo 成交在 -2bp 点位，1x5y repo 成交在 08.5bp 点位，报收 08.75/08.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 86/85，5y shibor 报收 93.75/93。曲线方面，1x5y shibor 报收 8.75/7。基差方面，1y basis 成交在 10.25bp 点位，报收 10.25/9.5，5y basis 成交在 09.5bp，报收 09.5/09。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

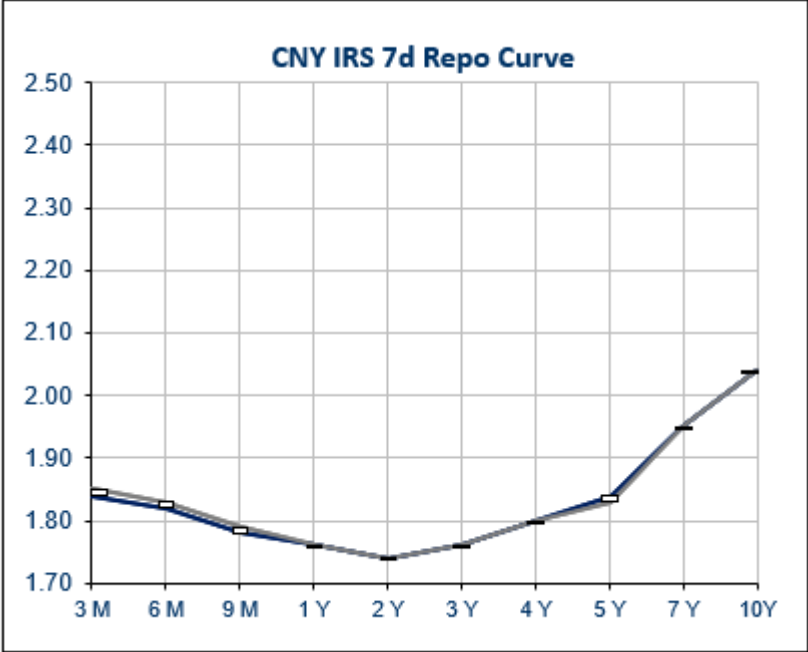
2024/8/29 Thursday

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	1.84	-1				3 M	1.7	-									
6 M	1.82	-1	6 M	1.92	-1	6 M	1.69	2									
9 M	1.78	-1	9 M	1.89	-	9 M	1.69	4									
1 Y	1.76	-	1 Y	1.86	-	1 Y	1.75	7				1Y	1.75	-			
2 Y	1.74	-	2 Y	1.85	1	2 Y	1.63	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.71	-			
3 Y	1.76	-	3 Y	1.85	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.72	-			
4 Y	1.8	-	4 Y	1.89	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.76	-			
5 Y	1.84	1	5 Y	1.93	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.79	-			
7 Y	1.95	-	7 Y	2.01	1				7 Y	1.8	-						
10Y	2.04	-	10Y	2.09	1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.90	-	3M Shibor	1.85	-	0-N Shibor	1.514	-0.60	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	-	-3	1				
9M*1Y	-2	1	-3	-	6M	10	-	
1*2Y	-2	-	-1	1	9M	11	1	
1*3Y	0	-	-1	-	1Y	10	-	
1*4Y	4	-	3	1	2Y	11	1	
1*5Y	8	1	7	-	3Y	9	-	
2*3Y	2	-	0	-1	4Y	9	1	
2*4Y	6	-	4	-	5Y	9	-1	
2*5Y	10	1	8	-1				
3*4Y	4	-	4	1				
3*5Y	8	1	8	-				
4*5Y	4	1	4	-1				
5*7Y	11	-1	8	1				
5*10Y	20	-1	16	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	33	31	27	24	22	21
今日	36	33	31	27	24	22	21

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	0	32	10	42
今日	-1	33	10	42



联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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:
以上所发及所附的所有信息（以下简称“信息”）仅供以提供信息，并非投资建议或任何形式的投资建议。其知识仅限于上海国际货币经纪有限公司（以下简称“上海国际货币”）或其关联方。“信息”不应也不应被解释为任何投资建议、投资建议或投资建议。投资者应自行承担相关的风险、定价、建议或建议。“信息”不可作为决策依据，也不保证其准确性、及时性或准确性等要求。且可未经通知而进行修改。所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang