



【2024-09-11】

中国人民银行今日进行 2100 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 7 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 2093 亿元。资金面均衡偏松。7d repo fixing: 1.94%，与上一交易日下降 1bp，3m shibor fixing: 1.8510%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.72%附近，后震荡下行，成交在 1.72%-1.7025%区间附近，午盘报收 71/70.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.715%-1.705%区间附近，报收 71.25/71。1y repo 全天震荡成交在 1.7075%-1.6925%区间附近，报收 70.75/70.25。

其他期限，3m repo 成交在 1.85%-1.855%区间附近，6m repo 成交在 1.81%-1.815%区间附近，9m repo 成交在 1.74%区间附近，3y repo 成交在 1.65%-1.655%区间附近，4y repo 成交在 1.67%区间附近。曲线方面，，3mx6m repo 成交在-4bp 点位，6mx1y repo 成交在-11.75bp 点位，9mx1y repo 成交在-4.5 到-4.25bp 点位，2x5y repo 成交在 06bp 区间附近，1x3x4y repo 成交在 06.75bp 附近，1x5y repo 成交在 1.25-00.75bp 区间附近，报收 01/00.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 79.25/78，3y shibor 成交在 1.72%附近，5y shibor 成交在 1.7925%附近，报收 79/77.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 01/-0.25。基差方面，1y basis 报收 08.75/07.75，5y basis 报收 08/06.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

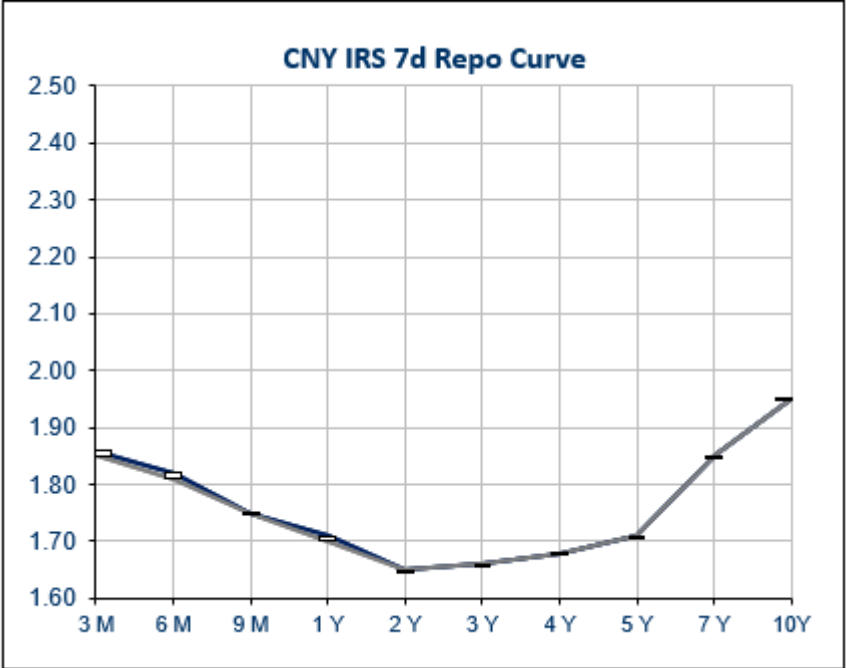
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/9/11 Wednesday

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	1.86	1				3 M	1.75	-									
6 M	1.82	1	6 M	1.91	-	6 M	1.75	-									
9 M	1.75	-	9 M	1.83	-1	9 M	1.75	2									
1 Y	1.71	1	1 Y	1.79	-1	1 Y	1.75	2				1Y	1.69	1			
2 Y	1.65	-	2 Y	1.73	-1	2 Y	1.75	16	2 Y	1.65	-	2Y	1.62	-			
3 Y	1.66	-	3 Y	1.73	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.62	1			
4 Y	1.68	-	4 Y	1.75	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.66	-			
5 Y	1.71	-	5 Y	1.78	-2				5 Y	1.8	-	5Y	1.66	-			
7 Y	1.85	-	7 Y	1.87	-				7 Y	1.8	-						
10Y	1.95	-	10Y	1.96	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.94	-1.00	3M Shibor	1.851	-	0-N Shibor	1.773	-18.20	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-7	-1	-8	-1				
9M*1Y	-4	1	-4	-	6M	9	-1	
1*2Y	-6	-1	-6	-	9M	8	-1	
1*3Y	-5	-1	-6	-	1Y	8	-2	
1*4Y	-3	-1	-4	-	2Y	8	-1	
1*5Y	0	-1	-1	-1	3Y	7	-1	
2*3Y	1	-	0	-	4Y	7	-1	
2*4Y	3	-	2	-	5Y	7	-2	
2*5Y	6	-	5	-1				
3*4Y	2	-	2	-				
3*5Y	5	-	5	-1				
4*5Y	3	-	3	-1				
5*7Y	14	-	9	2				
5*10Y	24	-	18	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	-3	38	14	48
今日	-5	36	12	46



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, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权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与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的推介、定价、建议或请求。“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。所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang