



【2024-09-02】

中国央行今日进行 35 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 4710 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 4675 亿元。资金面全天均衡。7d repo fixing: 1.85%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.85%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.82%附近，后震荡下行成交在 1.8475 %-1.8125%区间附近，午盘报收 81.75/81.25。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.8125%-1.7975%区间附近，报收 79.75/79.5。1y repo 早盘成交 1.725%，后全天震荡成交在 1.73%-1.7075%区间附近，报收 71.25/71。其他期限，6m repo 成交在 1.79-1.785%区间附近，9m repo 成交在 1.7475%-1.74%区间附近，2y repo 成交在 1.7125%-1.6925%区间，4y repo 成交在 1.7625%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-4.25bp 点位，1x2y repo 成交在-1.5bp 点位，2x5y repo 成交在 11bp-10.75bp 区间附近，1x5y repo 成交在 09.5bp-08.75bp 区间附近，报收 8.75/8.5，6mx9mx1y repo 成交在-1.5bp。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 82.25/81.75，5y shibor 报收 89.25/88。曲线方面，1x5y shibor 报收 7.5/6。基差方面，1y basis 报收 11.25/10.75，5y basis 报收 9.5/08.25。

LPR 端，5y LPR_5y 成交在 3.69%，报收 74/69。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

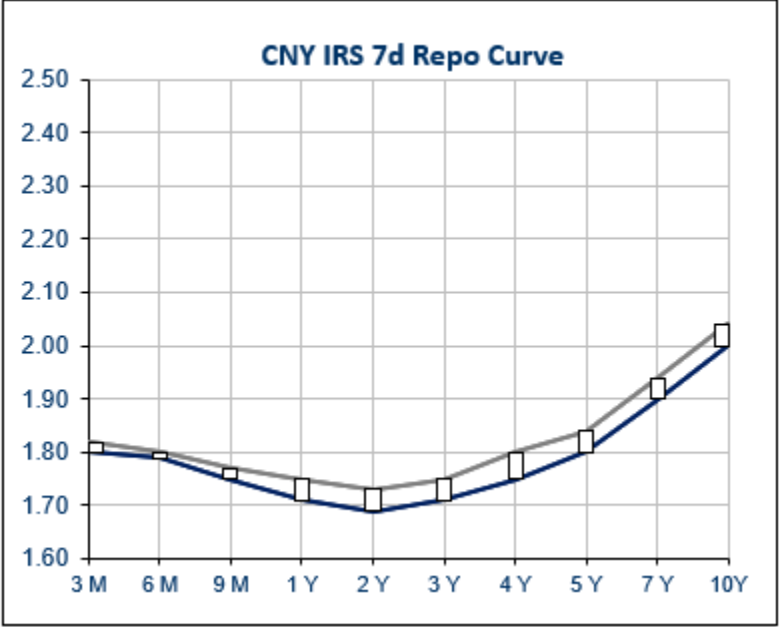
2024/9/2 Monday

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	1.8	-2				3 M	1.67	-2									
6 M	1.79	-1	6 M	1.89	-	6 M	1.65	-1									
9 M	1.75	-2	9 M	1.85	-2	9 M	1.66	1									
1 Y	1.71	-4	1 Y	1.82	-2	1 Y	1.75	9				1Y	1.7	-4			
2 Y	1.69	-4	2 Y	1.8	-3	2 Y	1.6	-2	2 Y	1.65	-	2Y	1.67	-4			
3 Y	1.71	-4	3 Y	1.81	-3	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.68	-4			
4 Y	1.75	-5	4 Y	1.85	-3				4 Y	1.8	-	4Y	1.72	-4			
5 Y	1.8	-4	5 Y	1.89	-4				5 Y	1.8	-	5Y	1.75	-5			
7 Y	1.9	-4	7 Y	1.97	-3				7 Y	1.8	-						
10Y	2	-4	10Y	2.05	-3				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.85	-2.00	3M Shibor	1.85	-	0-N Shibor	1.516	-1.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-1	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	-1	-4	-2				
9M*1Y	-4	-2	-3	-	6M	10	1	
1*2Y	-2	-	-2	-1	9M	10	-	
1*3Y	0	-	-1	-1	1Y	11	2	
1*4Y	4	-1	3	-1	2Y	11	1	
1*5Y	9	-	7	-2	3Y	10	1	
2*3Y	2	-	1	-	4Y	10	2	
2*4Y	6	-1	5	-	5Y	9	-	
2*5Y	11	-	9	-1				
3*4Y	4	-1	4	-				
3*5Y	9	-	8	-1				
4*5Y	5	1	4	-1				
5*7Y	10	-	8	1				
5*10Y	20	-	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	-1	33	10	42
今日	-2	34	9	44



联系人: Ruby Hu
邮箱: visiting.hu@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。其知识产仅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、股票或任何交易策略相关的推介、定价、建议或建议。“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免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang