



【2024-10-17】

中国央行今日进行 1326 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平。今日有 1500 元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 174 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.88%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.8550%，与上一交易日上升 0.9bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.75%附近，后震荡成交在 1.7425%-1.76%区间附近，午盘报收 74.5/74。中午回来，5y repo 小幅震荡下行，成交在 1.74%-1.7225%区间附近，报收 72.75/72.25。1y repo 全天震荡成交在 1.675%-1.70%区间附近，报收 69.5/69。其他期限，3m repo 成交在 1.91%-1.9175%区间附近，6m repo 成交在 1.805%附近，9m repo 成交在 1.7375%-1.74%区间附近，2y repo 成交在 1.6275%附近，3y repo 成交在 1.6425%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 -7bp 点位，3x5y repo 成交在 9.5bp 点位，1x5y repo 成交在 03-06.25bp 区间附近，曲线走平，报收 3.5/3。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.755%附近，报收 74.5/74，5y shibor 成交在 1.765%-1.775%区间附近，报收 76.75/76.25。曲线方面，1x5y shibor 成交在 01-02bp 区间，报收 2.5/2。基差方面，1y basis 报收 5/4.5，5y basis 成交在 3.75bp 点位，报收 4/3.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

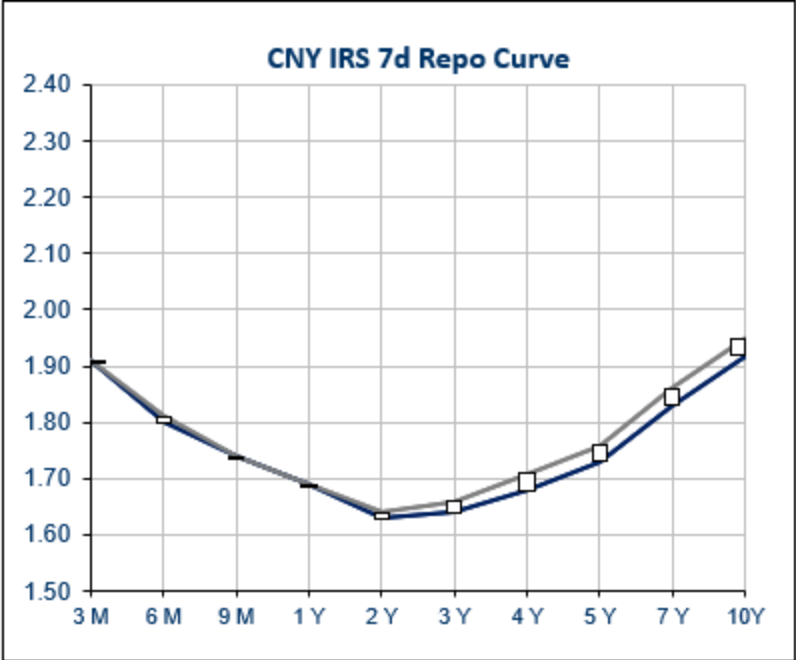
2024/10/17 星期四

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1. 91	-				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 8	-1	6 M	1. 83	-	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 74	-	9 M	1. 78	1	9 M	1. 5	-						
1 Y	1. 69	-	1 Y	1. 74	-	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 69	1
2 Y	1. 63	-1	2 Y	1. 68	-	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 62	1
3 Y	1. 64	-2	3 Y	1. 68	-1	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 62	-2
4 Y	1. 68	-3	4 Y	1. 72	-2				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 71	-1
5 Y	1. 73	-3	5 Y	1. 76	-3				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 7	-3
7 Y	1. 83	-3	7 Y	1. 86	-2				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 92	-3	10Y	1. 95	-1				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.88	-2.00	3M Shibor	1. 855	0.90	O-N Shibor	1.425	-3.50	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-11	-1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	1	-5	1				
9M*1Y	-5	-	-4	-1	6M	3	1	
1*2Y	-6	-1	-6	-	9M	4	1	
1*3Y	-5	-2	-6	-1	1Y	5	-	
1*4Y	-1	-3	-2	-2	2Y	5	1	
1*5Y	4	-3	2	-3	3Y	4	1	
2*3Y	1	-1	0	-1	4Y	4	1	
2*4Y	5	-2	4	-2	5Y	3	-	
2*5Y	10	-2	8	-3				
3*4Y	4	-1	4	-1				
3*5Y	9	-1	8	-2				
4*5Y	5	-	4	-1				
5*7Y	10	-	10	1				
5*10Y	19	-	19	2				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	26	21	17	12	10	9	8
今日	26	21	17	12	10	9	8

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	1	38	9	46
今日	0	38	9	47



联系人: Ruby Bu
邮箱: viaoting.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