



【2024-10-31】

中国央行今日开展 3276 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 7989 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 4713 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.87%，与上一交易日下降 0.3bp，3m shibor fixing: 1.8840%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.805%附近，后震荡成交在 1.81%-1.80%区间附近，午盘报收 8025/80。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.7825%-1.805%区间附近，报收 79/78.75。1y repo 全天震荡成交在 1.7225%-1.6975%区间附近，报收 70.75/70.25。其他期限，1m repo 成交在 1.86%区间附近，3m repo 成交在 1.8925%-1.905%区间附近，6m repo 成交在 1.795%-1.805%区间附近，9m repo 成交在 1.75%-1.7775%区间附近，2y repo 成交在 1.6775%区间附近，3y repo 成交在 1.6875%-1.69%区间附近，4y repo 成交在 1.7475%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在-09bp 到-09.25bp 区间，6mx9m repo 成交-04.5bp 到-04.75bp 附近，9mx1y repo 成交在-03.25bp 附近，1x2y repo 成交在-04.25bp 附近，3x5y repo 成交在 11.25bp 附近，1x5y repo 报收 8.5/7.75，曲线走平。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 成交在 1.74%附近，报收 74/73.25，5y shibor 报收 85/83.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 11/09.75。基差方面，1y basis 报收 03.25/03，5y basis 报收 06.25/5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

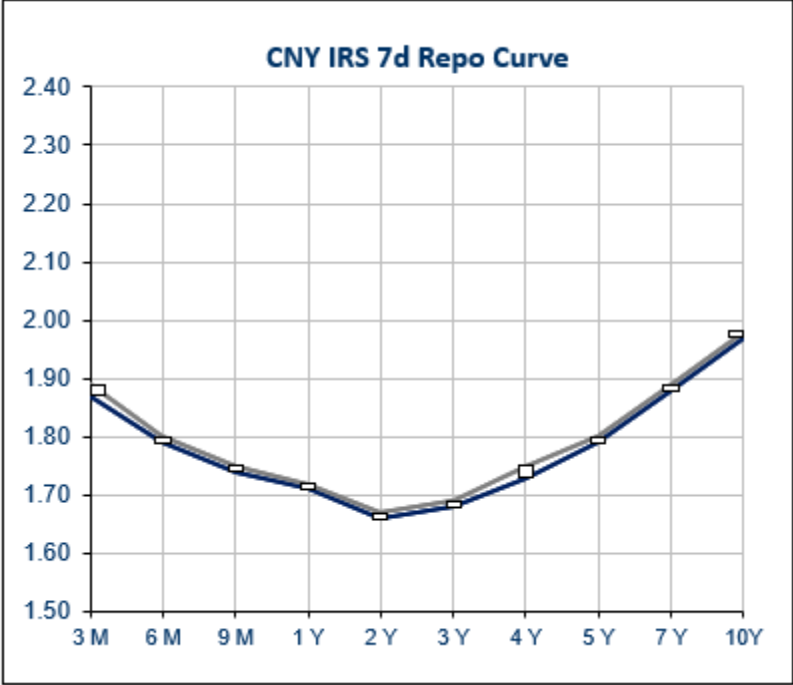
2024/10/31 星期四

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	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1. 87	-2				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 79	-1	6 M	1. 83	-1	6 M	1. 45	-15									
9 M	1. 74	-1	9 M	1. 78	-1	9 M	1. 45	-15									
1 Y	1. 71	-1	1 Y	1. 74	-2	1 Y	1. 45	-15				1Y	1. 7	-1			
2 Y	1. 66	-1	2 Y	1. 71	-1	2 Y	1. 5	-10	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 65	-1			
3 Y	1. 68	-1	3 Y	1. 73	-1	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 66	-1			
4 Y	1. 73	-2	4 Y	1. 77	-2				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 74	-1			
5 Y	1. 79	-1	5 Y	1. 84	-1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 76	-2			
7 Y	1. 88	-1	7 Y	1. 94	-1				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 97	-1	10Y	2. 03	-1				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.87	-3.00	3M Shibor	1. 884	-	O-N Shibor	1.364	-3.00	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-8	1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-5	-	-5	-				
9M*1Y	-3	-	-4	-1	6M	4	-	
1*2Y	-5	-	-3	1	9M	4	-	
1*3Y	-3	-	-1	1	1Y	3	-1	
1*4Y	2	-1	3	-	2Y	5	-	
1*5Y	8	-	10	1	3Y	5	-	
2*3Y	2	-	2	-	4Y	4	-	
2*4Y	7	-1	6	-1	5Y	5	-	
2*5Y	13	-	13	-				
3*4Y	5	-1	4	-1				
3*5Y	11	-	11	-				
4*5Y	6	1	7	1				
5*7Y	9	-	10	-				
5*10Y	18	-	19	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	11	9	7	4	3	3	4
今日	11	8	6	2	1	0	1

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-1	37	8	47
今日	-2	36	6	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:
以上所述及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅得以提供信息, 且为保密的或/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任何金融工具、投资建议或任何交易策略相关的报价、出价、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。所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang