



【2024-10-14】

中国央行今日进行 195 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平，因今日无逆回购到期，当日实现净投放 195 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.92%，与上一交易日上升 35bp，3m shibor fixing: 1.8410%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.7725%附近，后下行成交在 1.775%-1.7575%区间附近，午盘报收 76.5/76.25。中午回来，5y repo 小幅震荡成交在 1.7675%-1.7775%区间附近，报收 76.75/76.5。1y repo 全天震荡成交在 1.6675%-1.6425%区间附近，报收 66.5/66。其他期限，3m repo 成交在 1.87%-1.875%区间附近，6m repo 成交在 1.76%-1.775%附近，9m repo 成交在 1.69%附近，3y repo 成交在 1.655%-1.66%区间附近，4y repo 成交在 1.7225%-1.7075%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 -7bp 附近，3x4y repo 成交在 06.25-06.5bp 区间附近，3x5y repo 成交在 11.75bp 附近，1x5y repo 成交在 10.75bp-11.5bp 区间附近，报收 10.75/10.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 72/71.5，5y shibor 报收 82.75/81。曲线方面，1x5y shibor 报收 11/09.5。基差方面，1y basis 报收 06/05，5y basis 报收 06/04.5。其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

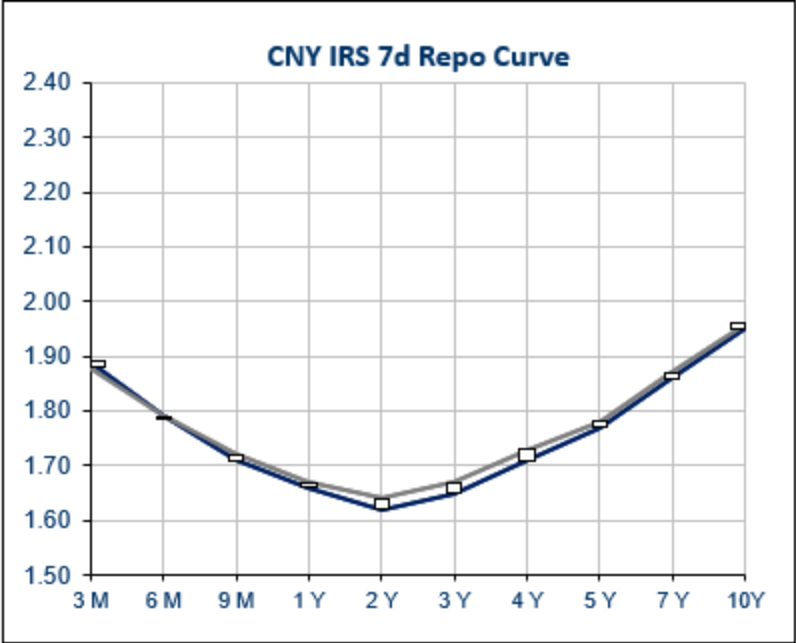
2024/10/14 星期一

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. 89	1				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 79	-	6 M	1. 82	1	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 71	-1	9 M	1. 75	-1	9 M	1. 5	-									
1 Y	1. 66	-1	1 Y	1. 72	-	1 Y	1. 5	-							1Y	1. 65	-1
2 Y	1. 62	-2	2 Y	1. 68	-1	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2 Y	1. 6	-1	2Y	1. 6	-1
3 Y	1. 65	-2	3 Y	1. 71	-3	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3 Y	1. 63	-2	3Y	1. 63	-2
4 Y	1. 71	-2	4 Y	1. 76	-3				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 71	-1	4Y	1. 71	-1
5 Y	1. 77	-1	5 Y	1. 82	-2				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 74	-1	5Y	1. 74	-1
7 Y	1. 86	-1	7 Y	1. 91	-2				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 95	-1	10Y	1. 99	-2				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.92	35.00	3M Shibor	1. 841	-	O-N Shibor	1.418	11.20	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-10	-1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-8	-1	-7	-2				
9M*1Y	-5	-	-3	1	6M	3	1	
1*2Y	-4	-1	-4	-1	9M	4	-	
1*3Y	-1	-1	-1	-3	1Y	6	1	
1*4Y	5	-1	4	-3	2Y	6	1	
1*5Y	11	-	10	-2	3Y	6	-1	
2*3Y	3	-	3	-2	4Y	5	-1	
2*4Y	9	-	8	-2	5Y	5	-1	
2*5Y	15	1	14	-1				
3*4Y	6	-	5	-				
3*5Y	12	1	11	1				
4*5Y	6	1	6	1				
5*7Y	9	-	9	-				
5*10Y	18	-	17	-				

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	36	8	45
今日	0	37	7	45



联系人: Ruby Wu
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:
以上所发及所加的所有信息 (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