



【2024-10-30】

中国央行今日进行 4310 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 7927 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 3617 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日持平，3m shibor fixing: 1.8840%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.79%附近，后震荡成交在 1.785%-1.7975%区间附近，午盘报收 79/78.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.785%-1.805%区间附近，报收 80/79.75。1y repo 全天震荡成交在 1.70%-1.72%区间附近，报收 71.75/71.5。其他期限，1m repo 成交在 1.85%区间附近，3m repo 成交在 1.88%-1.8825%区间附近，6m repo 成交在 1.79%-1.7975%区间附近，9m repo 成交在 1.7375%-1.75%区间附近，2y repo 成交在 1.67%-1.675%区间附近，3y repo 成交在 1.68%-1.695%区间附近。曲线方面，3mx6m 成交在-9bp 附近，6mx9m repo 成交-5bp 到-5.25bp 附近，9mx1y repo 成交在-3.25bp 附近，6mx1y repo 成交在-8.25bp 附近，3x5y repo 成交在 11bp 附近，1x5y repo 成交在 08bp-08.5bp 区间附近，报收 8.75/8.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 76/75.5，5y shibor 报收 85.75/85。曲线方面，1x5y shibor 报收 9.75/9。基差方面，1y basis 报收 4.5/4，5y basis 报收 5.75/5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

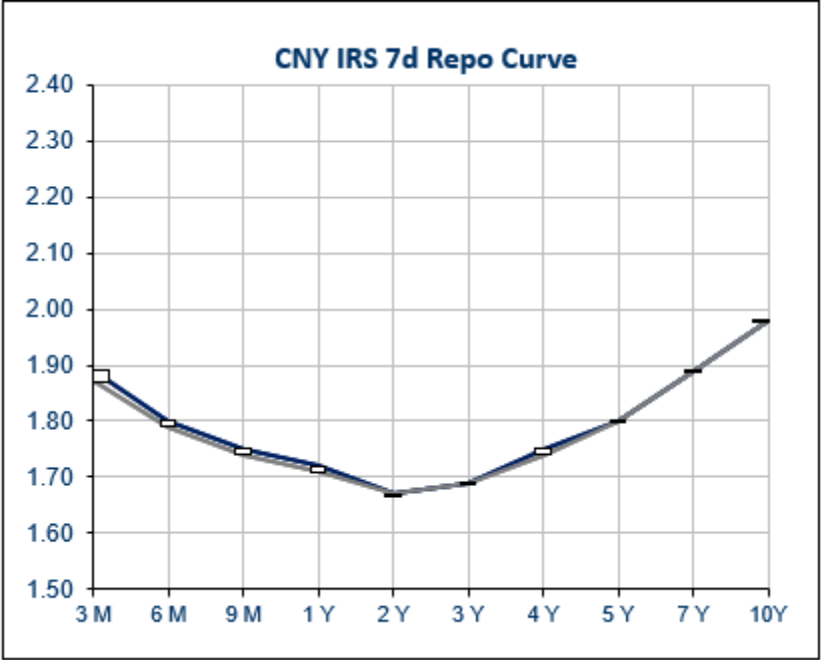
2024/10/30 星期三

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. 89	2				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 8	1	6 M	1. 84	-	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 75	1	9 M	1. 79	1	9 M	1. 6	-									
1 Y	1. 72	1	1 Y	1. 76	1	1 Y	1. 6	-				1Y	1. 71	1			
2 Y	1. 67	-	2 Y	1. 72	-	2 Y	1. 6	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 66	1			
3 Y	1. 69	-	3 Y	1. 74	-	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 67	-			
4 Y	1. 75	1	4 Y	1. 79	-				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 75	-			
5 Y	1. 8	-	5 Y	1. 85	-1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 78	-			
7 Y	1. 89	-	7 Y	1. 95	-				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 98	-	10Y	2. 04	-				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.90	-	3M Shibor	1. 884	-	O-N Shibor	1.394	-4.50	1Y DEPO	1.50							

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

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	0	37	8	46
今日	-1	37	8	47



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:
以上所发及网站的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 且为保密的利/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国脉货币”) 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、建议或诱导。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、及时性或完整性等要求, 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