



【2024-10-23】

中国央行今日开展 7927 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 6424 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 1503 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.8730%，与上一交易日上升 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.79%附近，随后上行成交在 1.7825%-1.83%区间附近，午盘报收 83/82.5。中午回来，5y repo 小幅回落，成交在 1.83%-1.8075%区间附近，报收 81.5/81。1y repo 全天震荡成交在 1.75%-1.7225%区间附近，报收 73.5/73.25。其他期限，3m repo 成交在 1.95%附近，6m repo 成交在 1.8425%-1.8475%区间附近，9m repo 成交在 1.7825%-1.7875%区间附近，2y repo 成交在 1.68%-1.685%区间附近，3y repo 成交在 1.6975%-1.7075%区间附近。4y repo 成交在 1.7475%-1.75%区间附近。

曲线方面，6mx9m repo 成交在-6 到-6.5bp 点位，9x1y repo 成交在-04.75bp，3x4y repo 成交在 5.25bp 点位，4x5y repo 成交在 05.5b 点位，1x5y repo 成交在 06.25-08.25bp 区间附近，曲线走陡，报收 8.25/7.75。

Shibor 端，1y shibor 报收 80.25/79.75，5y shibor 报收 89/88。曲线方面，1x5y shibor 报收 9/7.75。基差方面，1y basis 报收 7.5/6.5，5y basis 报收 8/6.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

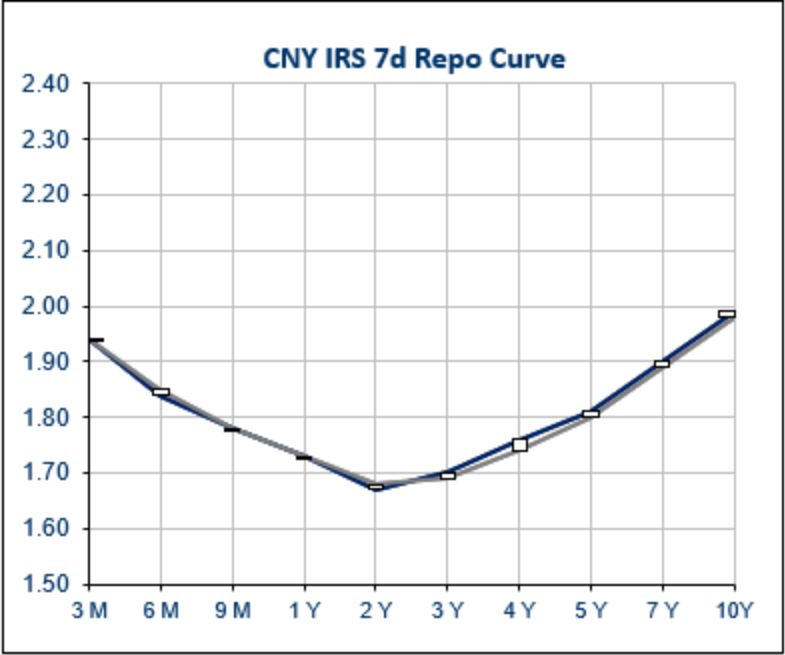
2024/10/23 星期三

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	1.94	-				3 M	1.6	-						
6 M	1.84	-1	6 M	1.86	-3	6 M	1.6	-						
9 M	1.78	-	9 M	1.83	-1	9 M	1.6	-						
1 Y	1.73	-	1 Y	1.8	-	1 Y	1.6	-				1Y	1.73	-
2 Y	1.67	-1	2 Y	1.75	-	2 Y	1.6	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.67	-
3 Y	1.7	1	3 Y	1.77	1	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.69	1
4 Y	1.76	2	4 Y	1.83	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.77	1
5 Y	1.81	1	5 Y	1.89	2				5 Y	1.8	-	5Y	1.79	1
7 Y	1.9	1	7 Y	1.97	1				7 Y	1.8	-			
10Y	1.99	1	10Y	2.06	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-2.00	3M Shibor	1.873	0.40	O-N Shibor	1.49	1.30	1Y DEPO	1.50				

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

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	35	8	43
今日	1	35	9	44



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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或者有担保的信息, 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”) 或其三方。“信息”不能也不应被解释为任何投资建议、投资建议或任何交易策略相关的报价、定价、建议或请求。“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, 所有前述和保证均按明确免责声明声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang