



【2024-10-28】

中国央行今日进行 2416 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 2089 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.93%，与上一交易日下降 7bp，3m shibor fixing: 1.8840%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.81%附近，后震荡成交在 1.805%-1.82%区间附近，午盘报收 81.5/81。中午回来，5y repo 小幅震荡下行，成交在 1.8175%-1.805%区间附近，报收 81.25/80.75。1y repo 全天震荡成交在 1.71%-1.72%区间附近，报收 71.25/70.75。其他期限，1m repo 成交在 1.89%-1.86%区间附近，3m repo 成交在 1.8875%-1.8825%区间附近，6m repo 成交在 1.7925%附近，2y repo 成交在 1.67%-1.6725%区间附近，3y repo 成交在 1.70%附近，4y repo 成交在 1.765%-1.77%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-4.5~-4.75bp 区间附近，2x4y repo 成交在 9.25bp 点位，2x5y repo 成交在 14.25bp 点位，1x5y repo 成交在 9.5-9.75bp 区间附近，报收 10/9.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.76%附近，报收 76/75.5，2y shibor 成家在 1.72%-1.725%区间附近，5y shibor 报收 87/86.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 11.25/10.5。基差方面，1y basis 报收 4.75/4.25，5y basis 报收 6.25/5.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

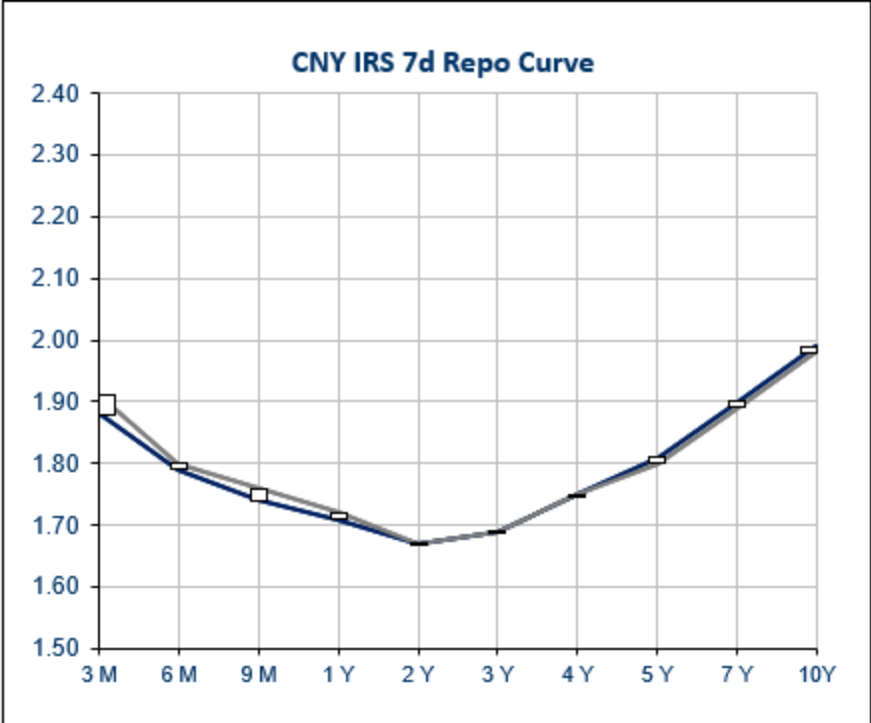
2024/10/28 星期一

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. 88	-3				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 79	-1	6 M	1. 83	-2	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 74	-2	9 M	1. 79	-3	9 M	1. 6	-									
1 Y	1. 71	-1	1 Y	1. 76	-3	1 Y	1. 6	-				1Y	1. 71	-1			
2 Y	1. 67	-	2 Y	1. 72	-1	2 Y	1. 6	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 66	-1			
3 Y	1. 69	-	3 Y	1. 74	-2	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 68	-1			
4 Y	1. 75	-	4 Y	1. 81	-				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 76	-1			
5 Y	1. 81	1	5 Y	1. 87	1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 79	-1			
7 Y	1. 9	1	7 Y	1. 96	1				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 99	1	10Y	2. 05	1				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.93	-7.00	3M Shibor	1. 884	0.10	O-N Shibor	1.495	-1.20	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
					Tenor	Mid	Δbp	
3M*6M	-9	2						
6M*9M	-5	-1	-4	-1				
9M*1Y	-3	1	-3	-	6M	4	-1	
1*2Y	-4	1	-4	2	9M	5	-1	
1*3Y	-2	1	-2	1	1Y	5	-2	
1*4Y	4	1	5	3	2Y	5	-1	
1*5Y	10	2	11	4	3Y	5	-2	
2*3Y	2	-	2	-1	4Y	6	-	
2*4Y	8	-	9	1	5Y	6	-	
2*5Y	14	1	15	2				
3*4Y	6	-	7	2				
3*5Y	12	1	13	3				
4*5Y	6	1	6	1				
5*7Y	9	-	9	-				
5*10Y	18	-	18	-				

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	1	36	7	45
今日	0	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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识“仅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报价、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, 所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang