



【2024-10-15】

中国央行：今日进行 683 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平，实现当日实现净投放 266 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.88%，与上一交易日下降 4bp，3m shibor fixing: 1.8420%，与上一交易日上行 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.77%附近，后震荡成交在 1.765%-1.7775%区间附近，午盘报收 77.25/77。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 1.76%-1.7425%区间附近，报收 74.25/73.75。1y repo 全天震荡成交在 1.68%-1.655%区间附近，报收 66.75/66.25。其他期限，3m repo 成交在 1.8875%-1.895%附近，6m repo 成交在 1.7825%附近，2y repo 成交在 1.625%附近，3y repo 成交在 1.645%区间附近，4y repo 成交在 1.70%附近。曲线方面，3mx1y repo 成交在-22.5bp 附近，1x2y repo 成交在-04 到-04.5bp，1x3x4y fly 成交在-07.75bp 区间附近，1x5y repo 成交在 08.5bp-10.25bp 区间附近，报收 08/07.5，曲线走平。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 71.5/70.5，5y shibor 成交在 1.8075%附近，报收 78.5/78。曲线方面，1x5y shibor 报收 08/06.5。基差方面，1y basis 报收 05/03.75，5y basis 成交在 03.25bp 附近，报收 04.25/03.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

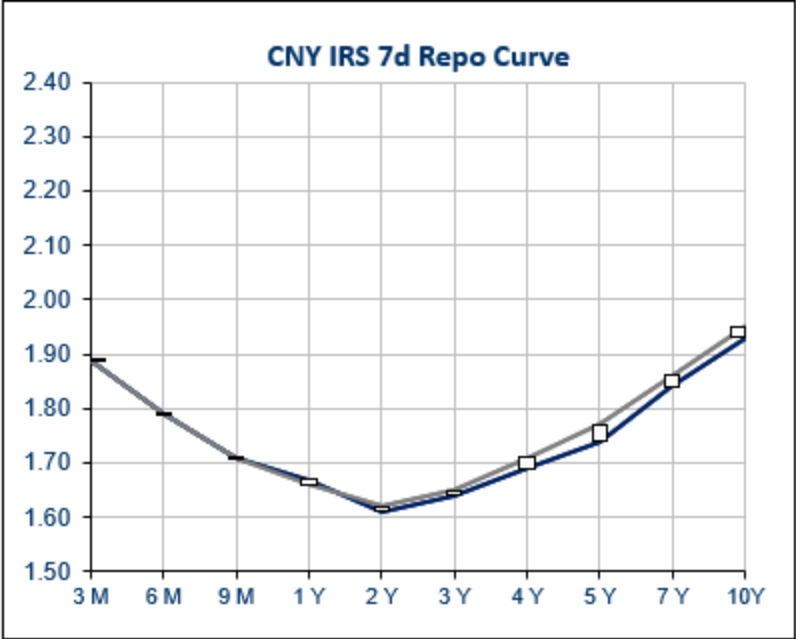
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/10/15 星期二

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	-				3 M	1.6	-						
6 M	1.79	-	6 M	1.81	-1	6 M	1.6	-						
9 M	1.71	-	9 M	1.75	-	9 M	1.5	-						
1 Y	1.67	1	1 Y	1.71	-1	1 Y	1.5	-				1Y	1.65	-
2 Y	1.61	-1	2 Y	1.67	-1	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.59	-1
3 Y	1.64	-1	3 Y	1.69	-2	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.61	-2
4 Y	1.69	-2	4 Y	1.74	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.69	-2
5 Y	1.74	-3	5 Y	1.79	-3				5 Y	1.8	-	5Y	1.71	-3
7 Y	1.84	-2	7 Y	1.88	-3				7 Y	1.8	-			
10Y	1.93	-2	10Y	1.96	-3				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.88	-4.00	3M Shibor	1.842	0.10	O-N Shibor	1.407	-1.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS			SHIBOR-REPO	
3M*6M	-10	-			Tenor	Mid	Δbp		
6M*9M	-8	-	-6	1					
9M*1Y	-4	1	-4	-1	6M	2	-1		
1*2Y	-6	-2	-4	-	9M	4	-		
1*3Y	-3	-2	-2	-1	1Y	4	-2		
1*4Y	2	-3	3	-1	2Y	6	-		
1*5Y	7	-4	8	-2	3Y	5	-1		
2*3Y	3	-	2	-1	4Y	5	-		
2*4Y	8	-1	7	-1	5Y	5	-		
2*5Y	13	-2	12	-2					
3*4Y	5	-1	5	-					
3*5Y	10	-2	10	-1					
4*5Y	5	-1	5	-1					
5*7Y	10	1	9	-					
5*10Y	19	1	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	0	37	7	45
今日	2	38	9	46



联系人: Ruby Hu
邮箱: ruby.hu@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”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国新证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国新证券”) 或其三方, “信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资策略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处理。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang