



【2024-10-11】

中国央行今日进行 942 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平。因今日有 2780 亿元 14 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1838 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 20bp，3m shibor fixing: 1.8410%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.7575%附近，后震荡上行，成交在 1.75%-1.77%区间附近，午盘报收 77.75/77.5。中午回来，5y repo 继续震荡上行，成交在 1.77%-1.7875%区间附近，报收 78.5/78.25。1y repo 全天震荡成交在 1.645%-1.675%区间附近，报收 67.75/67.25。其他期限，3m repo 成交在 1.86%附近，9m repo 成交在 1.70%附近，2y repo 成交在 1.60%-1.61%区间附近，4y repo 成交在 1.72%-1.725%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在 -4bp 点位，2x5y repo 成交在 15.5bp 点位，1x5y repo 成交在 11.25~11bp 区间附近，曲线走平，报收 11/10.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 73.75/72.25，5y shibor 报收 84.5/83。曲线方面，1x5y shibor 报收 11.25/9.25。基差方面，1y basis 报收 6/4，5y basis 报收 6/4.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

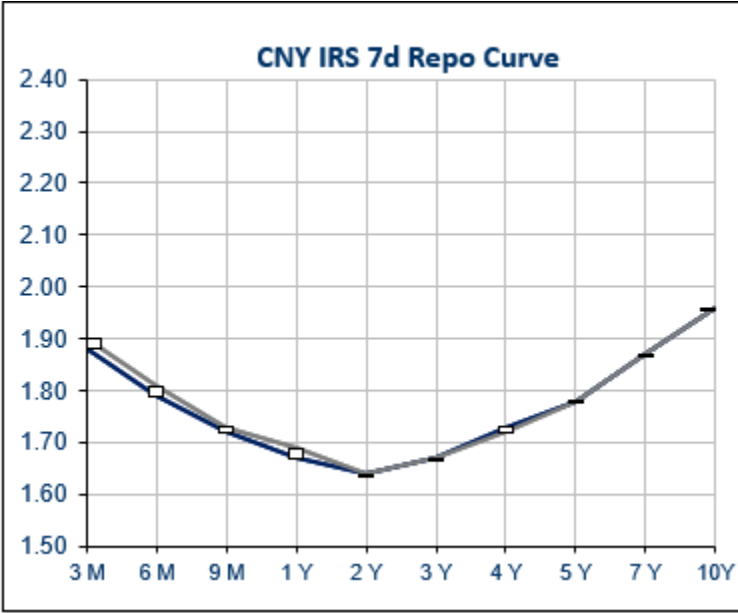
2024/10/11 星期五

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. 88	-2				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 79	-2	6 M	1. 81	-2	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 72	-1	9 M	1. 76	-2	9 M	1. 5	-5						
1 Y	1. 67	-2	1 Y	1. 72	-2	1 Y	1. 5	-5				1Y	1. 66	-1
2 Y	1. 64	-	2 Y	1. 69	-1	2 Y	1. 5	-5	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 61	-1
3 Y	1. 67	-	3 Y	1. 74	-	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 65	-
4 Y	1. 73	1	4 Y	1. 79	1				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 72	-
5 Y	1. 78	-	5 Y	1. 84	1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 75	-
7 Y	1. 87	-	7 Y	1. 93	-				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 96	-	10Y	2. 01	-				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.90	-20.00	3M Shibor	1. 841	-	O-N Shibor	1.406	-12.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-9	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-7	1	-5	-				
9M*1Y	-5	-1	-4	-	6M	2	-	
1*2Y	-3	2	-3	1	9M	4	-1	
1*3Y	0	2	2	2	1Y	5	-	
1*4Y	6	3	7	3	2Y	5	-1	
1*5Y	11	2	12	3	3Y	7	-	
2*3Y	3	-	5	1	4Y	6	-	
2*4Y	9	1	10	2	5Y	6	1	
2*5Y	14	-	15	2				
3*4Y	6	1	5	1				
3*5Y	11	-	10	1				
4*5Y	5	-1	5	-				
5*7Y	9	-	9	-1				
5*10Y	18	-	17	-1				

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	2	36	9	45
今日	1	36	8	45



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting.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, 且为保密的和/或者专用的信息, 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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang