



【2024-10-16】

中国央行公开市场开展 6424 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率 1.50%，与前次持平。今日 610 亿元逆回购到期。今日还有 7890 亿元 MLF 到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 1.8460%，与上一交易日上升 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.7425%附近，后震荡成交在 1.735%-1.75%区间附近，午盘报收 75/74.75。中午回来，5y repo 小幅震荡上行，成交在 1.7425%-1.76%区间附近，报收 76/75.5。1y repo 全天震荡上行，成交在 1.66%-1.695%区间附近，报收 69.5/69。其他期限，6m repo 成交在 1.81%附近，9m repo 成交在 1.74%附近，2y repo 成交在 1.62%附近，3y repo 成交在 1.6475%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 -7bp 附近，3x5y repo 成交在 10bp 附近，3x4y repo 成交在 5bp 附近，2x5y repo 成交在 12bp 附近，1x5y repo 成交在 08-5.75bp 区间附近，曲线走平，报收 6.75/6.25。

Shibor 端，1y shibor 报收 74/73，5y shibor 成交在 1.76%-1.7925%附近，报收 79.5/78.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 6.25/5。基差方面，1y basis 报收 5/4，5y basis 成交在 02-03.5bp 附近，报收 3.5/3。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

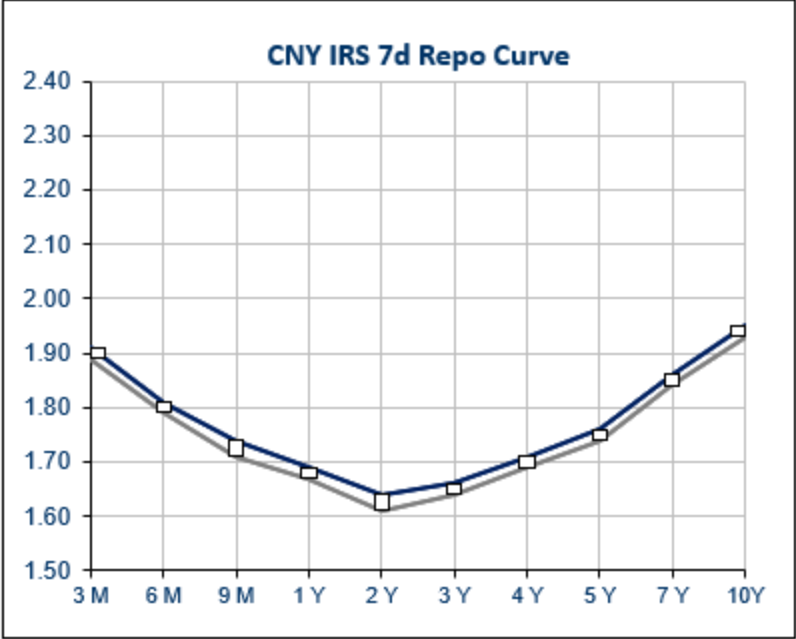
2024/10/16 星期三

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. 91	2				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 81	2	6 M	1. 83	2	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 74	3	9 M	1. 77	2	9 M	1. 5	-						
1 Y	1. 69	2	1 Y	1. 74	3	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 68	3
2 Y	1. 64	3	2 Y	1. 68	1	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 61	2
3 Y	1. 66	2	3 Y	1. 69	-	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 64	3
4 Y	1. 71	2	4 Y	1. 74	-				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 72	3
5 Y	1. 76	2	5 Y	1. 79	-				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 73	2
7 Y	1. 86	2	7 Y	1. 88	-				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 95	2	10Y	1. 96	-				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.90	2.00	3M Shibor	1. 846	0.40	O-N Shibor	1.46	5.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-10	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-7	1	-6	-				
9M*1Y	-5	-1	-3	1	6M	2	-	
1*2Y	-5	1	-6	-2	9M	3	-1	
1*3Y	-3	-	-5	-3	1Y	5	1	
1*4Y	2	-	0	-3	2Y	4	-2	
1*5Y	7	-	5	-3	3Y	3	-2	
2*3Y	2	-1	1	-1	4Y	3	-2	
2*4Y	7	-1	6	-1	5Y	3	-2	
2*5Y	12	-1	11	-1				
3*4Y	5	-	5	-				
3*5Y	10	-	10	-				
4*5Y	5	-	5	-				
5*7Y	10	-	9	-				
5*10Y	19	-	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	2	38	9	46
今日	1	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:
以上所述及附带的任何信息 (以下简称“信息”) 仅供参考, 不作为投资建议, 且为保密的、或有版权的信息, 其知识产权属于上海国新证券经纪有限公司 (以下简称“上海国新证券”) 或其三方。“信息”不应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、建议或提示。“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所述严格。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang