



【2024-11-05】

中国央行：今日进行 183 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 3828 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 3645 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing：1.79%，与上一交易日下降 1bp，3m shibor fixing: 1.8770%，较上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.77%附近，后震荡成交在 1.77%-1.785%区间附近，午盘报收 78/77.5。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 1.775%-1.76%区间附近，报收 76.25/76。1y repo 全天震荡成交在 1.6825%-1.6675%区间附近，报收 67.25/66.75。其他期限，3m repo 成交在 1.8275%点位，6m repo 成交在 1.735%-1.7425%区间附近，9m repo 成交在 1.7025%点位，2y repo 成交在 1.6325%-1.635%区间附近，3y repo 成交在 1.655%-1.665%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-3.75bp 点位，9mx1y repo 成交在-2.5bp 点位，6mx1y repo 成交在-6bp 点位，2x5y repo 成交在 13bp 区间附近，3x5y repo 成交在 10.75bp 区间附近，1x5y repo 成交在 10-9.5bp 区间附近，报收 09.5/09。

Shibor 端，1y shibor 报收 71/70，5y shibor 报收 82.25/81.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 12.25/10.25。基差方面，1y basis 报收 4/3.25，5y basis 报收 6/5.25。

LPR 端，1y LPR_3y 成交在 3.05%，报收 06.5/05。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

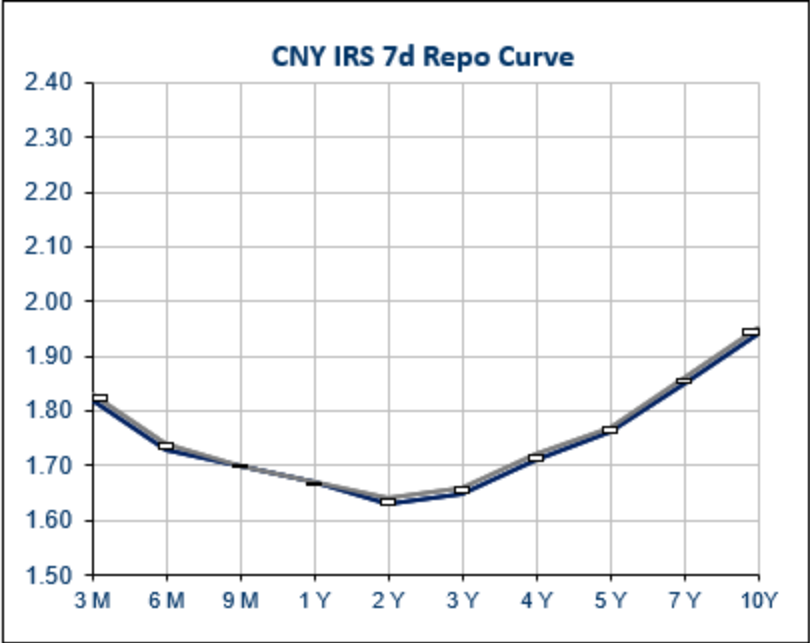
2024/11/5 星期二

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. 82	-1				3 M	1. 6	10						
6 M	1. 73	-1	6 M	1. 82	-	6 M	1. 6	10						
9 M	1. 7	-	9 M	1. 74	-	9 M	1. 6	10						
1 Y	1. 67	-	1 Y	1. 71	-	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 66	-
2 Y	1. 63	-1	2 Y	1. 68	-	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 62	-1
3 Y	1. 65	-1	3 Y	1. 7	-	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 64	-1
4 Y	1. 71	-1	4 Y	1. 76	-1				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 72	-1
5 Y	1. 76	-1	5 Y	1. 82	-2				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 74	-2
7 Y	1. 85	-1	7 Y	1. 92	-1				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 94	-1	10Y	2. 01	-1				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.79	1.00	3M Shibor	1. 877	-0.10	O-N Shibor	1.338	-0.80	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-9	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-3	1	-8	-				
9M*1Y	-3	-	-3	-	6M	9	1	
1*2Y	-4	-1	-3	-	9M	4	-	
1*3Y	-2	-1	-1	-	1Y	4	-	
1*4Y	4	-1	5	-1	2Y	5	1	
1*5Y	9	-1	11	-2	3Y	5	1	
2*3Y	2	-	2	-	4Y	5	-	
2*4Y	8	-	8	-1	5Y	6	-1	
2*5Y	13	-	14	-2				
3*4Y	6	-	6	-1				
3*5Y	11	-	12	-2				
4*5Y	5	-	6	-1				
5*7Y	9	-	10	1				
5*10Y	18	-	19	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	11	8	6	2	1	0	1
今日	11	9	7	4	4	5	6

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-1	37	7	47
今日	-1	37	8	47



联系人: Ruby Wu
邮箱: viaoting.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, 且为保密的利/或者专用的信息, 其知识产权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推介、定价、建议或请求。“信息”不可作为投资决策, 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, 所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN