



【2024-11-06】

中国央行今日开展 173 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 4310 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 4137 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.79%，与上一交易日持平，3m shibor fixing: 1.8760%，较上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.75%附近，后震荡成交在 1.7375%-1.75%区间附近，午盘报收 75/74.5。中午回来，5y repo 震荡上行，成交在 1.745%-1.76%区间附近，报收 76.25/76。1y repo 全天震荡成交在 1.6825%-1.66%区间附近，报收 68.25/68。其他期限，3m repo 成交在 1.845%-1.85%区间附近，6m repo 成交在 1.7525%-1.7575%区间附近，9m repo 成交在 1.7125%-1.715%区间附近，2y repo 成交在 1.6175%-1.6375%区间附近，3y repo 成交在 1.6525%点位。曲线方面，6mx9m repo 成交在-04.25bp 到-04.5bp 区间，9mx1y repo 成交在-03bp 到-03.25bp 区间，6mx1y repo 成交在-07.5bp 点位，1x2y repo 成交在-04bp 到-04.25bp 附近，2x5y repo 成交在 12bp 区间附近，3x5y repo 成交在 10.75bp 区间附近，1x5y repo 成交在 07.5bp 到 08bp 区间附近，报收 08.25/08。

Shibor 端，1y shibor 报收 71.5/71.25，5y shibor 报收 81.5/80.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 10.25/09。基差方面，1y basis 报收 3.5/3.25，5y basis 报收 5.5/4.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

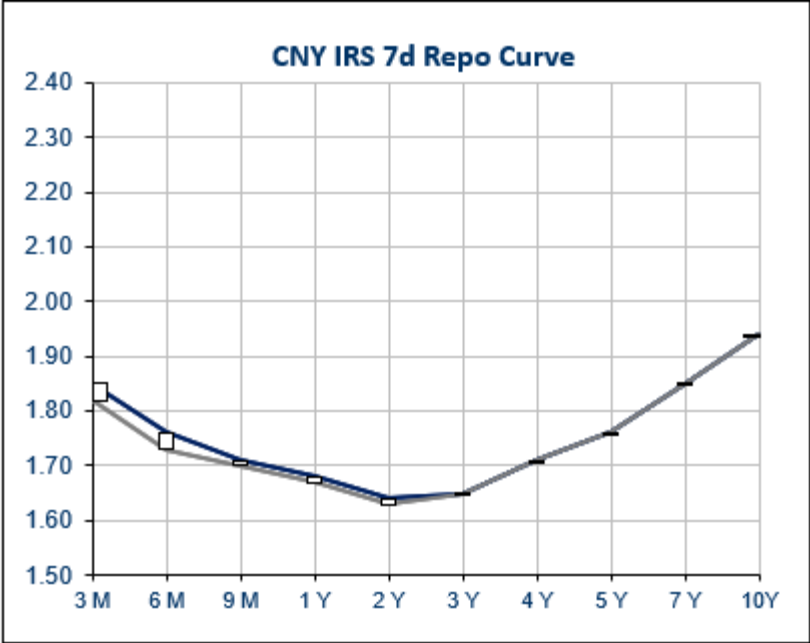
2024/11/6 星期三

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	1.85	3				3 M	1.6	-						
6 M	1.76	3	6 M	1.81	-1	6 M	1.6	-						
9 M	1.71	1	9 M	1.75	1	9 M	1.6	-						
1 Y	1.68	1	1 Y	1.71	-	1 Y	1.5	-				1Y	1.67	1
2 Y	1.64	1	2 Y	1.68	-	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.62	-
3 Y	1.65	-	3 Y	1.69	-1	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.63	-1
4 Y	1.71	-	4 Y	1.75	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.72	-
5 Y	1.76	-	5 Y	1.81	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.74	-
7 Y	1.85	-	7 Y	1.91	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	1.94	-	10Y	2	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.79	-	3M Shibor	1.876	-0.10	O-N Shibor	1.33	-0.80	1Y DEPO	1.50				

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

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	11	9	7	4	4	5	6
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	8	47
今日	-1	38	9	46



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、投资策略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, 也不保证其所提供、对盈利性或盈利性等要求, 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

文 / Joyce Zhang