



【2024-10-21】

中国央行今日开展 2089 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 427 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 1662 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.92%，与上一交易日上升 7bp，3m shibor fixing: 1.8640%，与上一交易日上升 0.6bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.745%附近，后震荡上行成交在 1.7625%-1.7375%区间附近，午盘报收 76.5/76.25。中午回来，5y repo 小幅震荡成交在 1.765%-1.75%区间附近，报收 76.75/76.25。1y repo 全天震荡成交在 1.705%-1.6875%区间附近，报收 70.25/70。其他期限，6m repo 成交在 1.805%-1.81%附近，9m repo 成交在 1.74%-1.7525%区间附近，2y repo 成交在 1.645%-1.64%区间附近，3y repo 成交在 1.6575%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-6.25bp 到-6.5bp 点位，2x3 repo 成交在 01.25bp 点位，1x5y repo 成交在 05-06.25bp 区间附近，报收 06.5/06。

Shibor 端，1y shibor 报收 76/74，5y shibor 报收 82.5/82。曲线方面，1x5y shibor 报收 08.5/06。基差方面，1y basis 报收 06/04，5y basis 报收 06/05.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

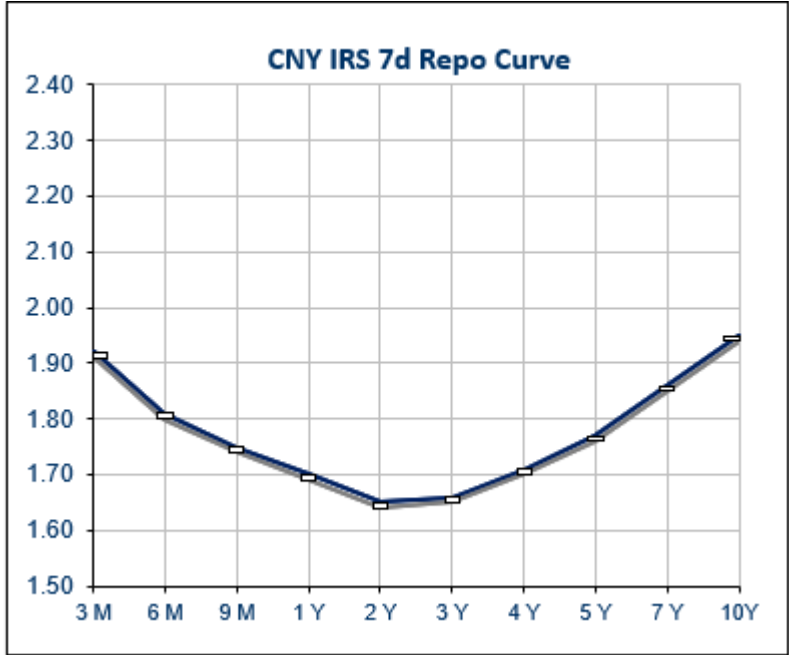
2024/10/21 星期一

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. 92	1				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 81	1	6 M	1. 84	1	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 75	1	9 M	1. 79	1	9 M	1. 6	10						
1 Y	1. 7	1	1 Y	1. 75	1	1 Y	1. 6	10				1Y	1. 7	2
2 Y	1. 65	1	2 Y	1. 69	-1	2 Y	1. 6	10	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 63	1
3 Y	1. 66	1	3 Y	1. 71	-	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 65	2
4 Y	1. 71	1	4 Y	1. 77	1				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 73	2
5 Y	1. 77	1	5 Y	1. 82	1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 74	2
7 Y	1. 86	1	7 Y	1. 91	1				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 95	1	10Y	2	1				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.92	7.00	3M Shibor	1. 864	0.60	O-N Shibor	1.474	7.50	1Y DEPO	1.50				

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

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	26	21	17	12	10	9	8
今日	11	2	6	2	1	2	2

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-1	37	8	45
今日	-1	36	8	44



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