



【2024-10-08】

中国央行今日进行 417 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 3941 亿元 7 天期逆回购到期和 5345 亿元 14 天逆回购到期，当日实现净回笼 8869 亿元。资金面全天偏紧。7d repo fixing: 1.9000%，与上一交易日下降 50bp，3m shibor fixing: 1.8400%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.885%附近，后震荡成交在 1.8875%-1.8025%区间附近，午盘报收 83.5/83。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.8275%-1.8625%区间附近，报收 86/85.5。1y repo 全天震荡成交在 1.6975%-1.64%区间附近，报收 69/68.5。其他期限，3m repo 成交在 1.80%附近，6m repo 成交在 1.76%附近，9m 成交在 1.705%-1.71%区间附近，2y repo 成交在 1.66%-1.69%区间附近。曲线方面，3x6m repo 成交在-4bp 点位，6x9m repo 成交在-5bp 点位，9mx1y repo 成交在-2~-2.5bp 区间附近，6mx1y 成交在-7.5bp 点位，1x5y repo 成交在 16.5bp-17.25bp 区间附近，报收 17/16.5。2x5y repo 成交在 17.25bp 点位。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 74/70.5。5y shibor 报收 91.5/90.5。基差方面，1y basis 报收 5/2，5y basis 报收 5.5/5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

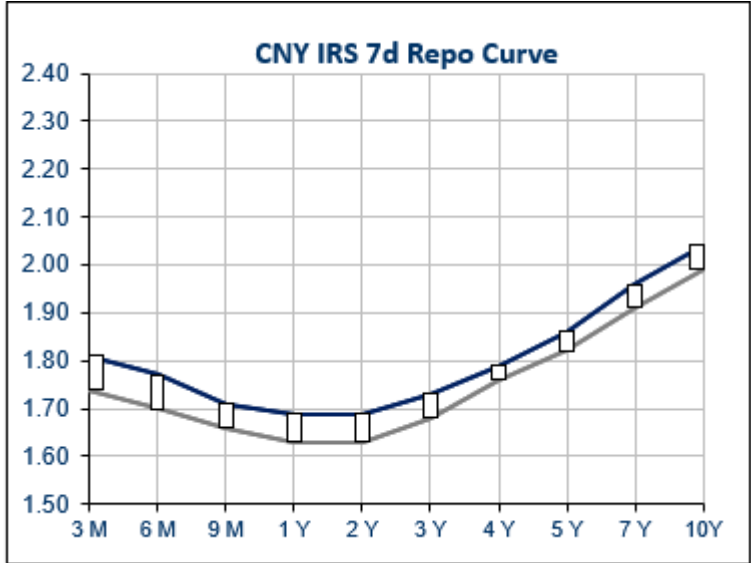
2024/10/8 星期二

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. 81	7				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 77	7	6 M	1. 84	1	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 71	5	9 M	1. 75	3	9 M	1. 55	-									
1 Y	1. 69	6	1 Y	1. 72	2	1 Y	1. 55	-				1Y	1. 62	-			
2 Y	1. 69	6	2 Y	1. 72	2	2 Y	1. 55	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 62	-			
3 Y	1. 73	5	3 Y	1. 77	3	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 67	-			
4 Y	1. 79	3	4 Y	1. 83	2				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 75	-			
5 Y	1. 86	4	5 Y	1. 91	2				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 8	-			
7 Y	1. 96	5	7 Y	2	6				7 Y	1. 8	-						
10Y	2. 04	5	10Y	2. 08	6				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.90	-50.00	3M Shibor	1. 84	-	O-N Shibor	1.509	-0.50	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	-2	-9	2				
9M*1Y	-2	1	-3	-1	6M	7	-6	
1*2Y	0	-	0	-	9M	4	-2	
1*3Y	4	-1	5	1	1Y	3	-4	
1*4Y	10	-3	11	-	2Y	3	-4	
1*5Y	17	-2	19	-	3Y	4	-2	
2*3Y	4	-1	5	1	4Y	4	-1	
2*4Y	10	-3	11	-	5Y	5	-2	
2*5Y	17	-2	19	-				
3*4Y	6	-2	6	-1				
3*5Y	13	-1	14	-1				
4*5Y	7	1	8	-				
5*7Y	10	1	9	4				
5*10Y	18	1	17	4				

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	0	34	7	42
今日	0	33	9	43



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiuting.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:
以上所发及附送的所有信息 (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市场结构有限责任公司 (以下简称“上海国际”) 或第三方, “信息”不应被解释为与任何金融工具、投资策略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