



【2024-11-04】

中国央行：今日进行 173 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 2416 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2243 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing：1.78%，与上一交易日下降 1bp，3m shibor fixing: 1.8780%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.7625%附近，后震荡成交在 1.7625%-1.775%区间附近，午盘报收 76.75/76.25。中午回来，5y repo 小幅震荡上行，成交在 1.77%-1.78%区间附近，报收 77.5/77.25。1y repo 全天震荡成交在 1.6775%-1.6625%区间附近，报收 67.5/67.25。其他期限，1m repo 成交在 1.80%-1.82%区间附近，3m repo 成交在 1.83%点位，6m repo 成交在 1.7325%-1.735%区间附近，9m repo 成交在 1.6975%点位，2y repo 成交在 1.635%-1.6375%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-3.75bp 点位，1x5y repo 成交在 10-9.75bp 区间附近，报收 10.25/10。

Shibor 端，1y shibor 报收 71/70.5，2y shibor 成交在 1.68%附近，5y shibor 报收 84.5/83.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 14/12.5。基差方面，1y basis 报收 3.75/3.25，5y basis 报收 7/6。

LPR 端，5y LPR_5y 成交在 3.58%，报收 60/57。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

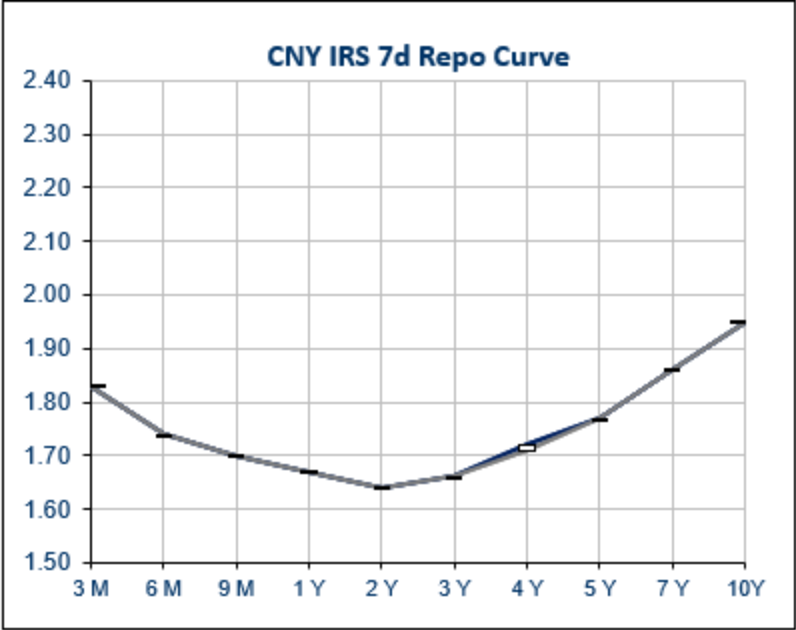
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/11/4 星期一

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	1.83	-				3 M	1.5	-10									
6 M	1.74	-	6 M	1.82	1	6 M	1.5	-10									
9 M	1.7	-	9 M	1.74	-1	9 M	1.5	-10									
1 Y	1.67	-	1 Y	1.71	-	1 Y	1.5	-10				1Y	1.66	-			
2 Y	1.64	-	2 Y	1.68	1	2 Y	1.5	-10	2 Y	1.65	-	2Y	1.63	-			
3 Y	1.66	-	3 Y	1.7	-1	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.65	-			
4 Y	1.72	1	4 Y	1.77	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.73	-			
5 Y	1.77	-	5 Y	1.84	1				5 Y	1.8	-	5Y	1.76	1			
7 Y	1.86	-	7 Y	1.93	-				7 Y	1.8	-						
10Y	1.95	-	10Y	2.02	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.78	-1.00	3M Shibor	1.878	-0.10	O-N Shibor	1.346	-1.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-9	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-4	-	-8	-2				
9M*1Y	-3	-	-3	1	6M	8	1	
1*2Y	-3	-	-3	1	9M	4	-1	
1*3Y	-1	-	-1	-1	1Y	4	-	
1*4Y	5	1	6	-	2Y	4	1	
1*5Y	10	-	13	1	3Y	4	-1	
2*3Y	2	-	2	-2	4Y	5	-1	
2*4Y	8	1	9	-1	5Y	7	1	
2*5Y	13	-	16	-				
3*4Y	6	1	7	1				
3*5Y	11	-	14	2				
4*5Y	5	-1	7	1				
5*7Y	9	-	9	-1				
5*10Y	18	-	18	-1				

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	38	7	47
今日	-1	37	7	47



联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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:
以上所述及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅得以提供信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识“仅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报价、出价、建议或请求。“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, 所有前述和保证均被明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang