



【2024-11-07】

中国央行今日进行 192 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 3276 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.80%，与上一交易日上升 1bp，3m shibor fixing: 1.8700%，与上一交易日下降 0.6bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.745%附近，后小幅震荡，成交在 1.745%-1.7325%区间附近，午盘报收 73.75/73.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.725%-1.7425%区间附近，报收 73.75/73.25。1y repo 全天震荡成交在 1.6625%-1.6375%区间附近，报收 64.25/64。其他期限，2y repo 成交在 1.6025%-1.62%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在 -4~-3.75 区间 bp 附近，2x5y repo 成交在 13-12.25bp 区间附近，1x5y repo 成交在 9-9.5bp 区间附近，报收 9.5/9.25。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.685%-1.66%附近，报收 66.75/66，5y shibor 报收 77.5/76.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 11.5/10。基差方面，1y basis 成交在 2bp 附近，报收 2.75/1.75，5y basis 报收 4.25/3.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

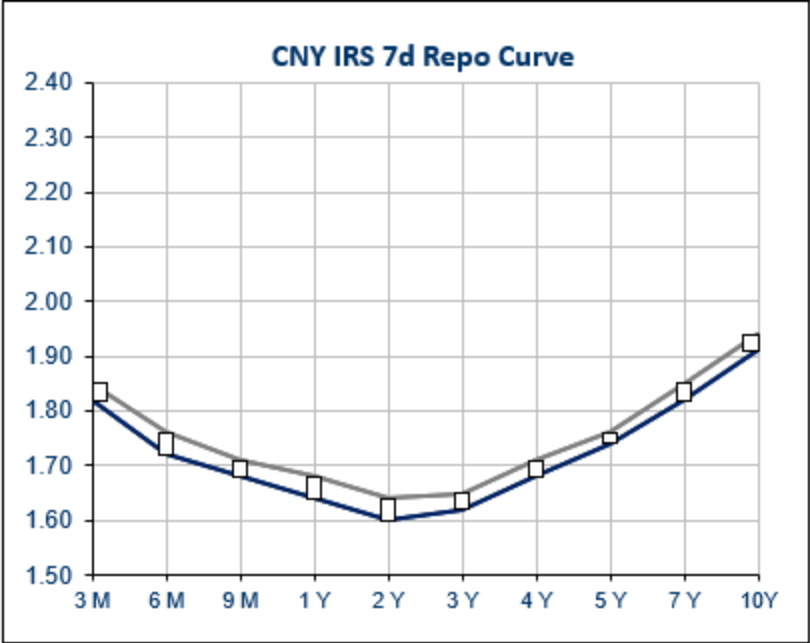
2024/11/7 星期四

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	-3				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 72	-4	6 M	1. 77	-4	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 68	-3	9 M	1. 71	-4	9 M	1. 6	-						
1 Y	1. 64	-4	1 Y	1. 66	-5	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 64	-3
2 Y	1. 6	-4	2 Y	1. 63	-5	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 59	-3
3 Y	1. 62	-3	3 Y	1. 65	-4	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 62	-1
4 Y	1. 68	-3	4 Y	1. 71	-4				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 7	-2
5 Y	1. 74	-2	5 Y	1. 77	-4				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 72	-2
7 Y	1. 82	-3	7 Y	1. 87	-4				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 91	-3	10Y	1. 96	-4				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.80	1.00	3M Shibor	1. 87	-0.60	O-N Shibor	1.319	-1.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-10	-1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-4	1	-6	-				
9M*1Y	-4	-1	-5	-1	6M	5	-	
1*2Y	-4	-	-3	-	9M	3	-1	
1*3Y	-2	1	-1	1	1Y	2	-1	
1*4Y	4	1	5	1	2Y	3	-1	
1*5Y	10	2	11	1	3Y	3	-1	
2*3Y	2	1	2	1	4Y	3	-1	
2*4Y	8	1	8	1	5Y	3	-2	
2*5Y	14	2	14	1				
3*4Y	6	-	6	-				
3*5Y	12	1	12	-				
4*5Y	6	1	6	-				
5*7Y	8	-1	10	-				
5*10Y	17	-1	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	38	9	46
今日	-1	39	9	49



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, 所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang