



【2024-10-09】

中国央行今日进行 610 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 1965 亿元 14 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1355 亿元。7d repo fixing: 2.05%，与上一交易日上升 15bp，3m shibor fixing: 1.8410%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.855%附近，后震荡成交在 1.87%-1.83%区间附近，午盘报收 85.5/84.75。中午回来，5y repo 震荡下行成交在 1.8625%-1.8275%区间附近，报收 84/83.5。1y repo 全天震荡成交在 1.6975%-1.725%区间附近，报收 71.25/70.5。其他期限，3m repo 成交在 1.795%-1.92%附近，6m repo 成交在 1.7575%-1.76%附近，9m repo 成交在 1.75%附近，2y repo 成交在 1.6975%区间附近。曲线方面，3x6m repo 成交在-04bp 到-04.25bp 区间，9mx1y repo 成交在-03.5bp 附近，1x2y repo 成交在-0.75bp 附近，2x5y repo 成交在 15bp 区间，1x5y repo 成交在 12bp-15bp 区间附近，报收在 13/12.5，曲线走平。

Shibor 端成交清淡，1y shibor 报收 78/76.25。5y shibor 报收 89.5/88.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 12.75/10.75。基差方面,1y basis 成交在 5.5-6.5bp 区间附近，报收 07/5.5，5y basis 报收 05.75/05.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

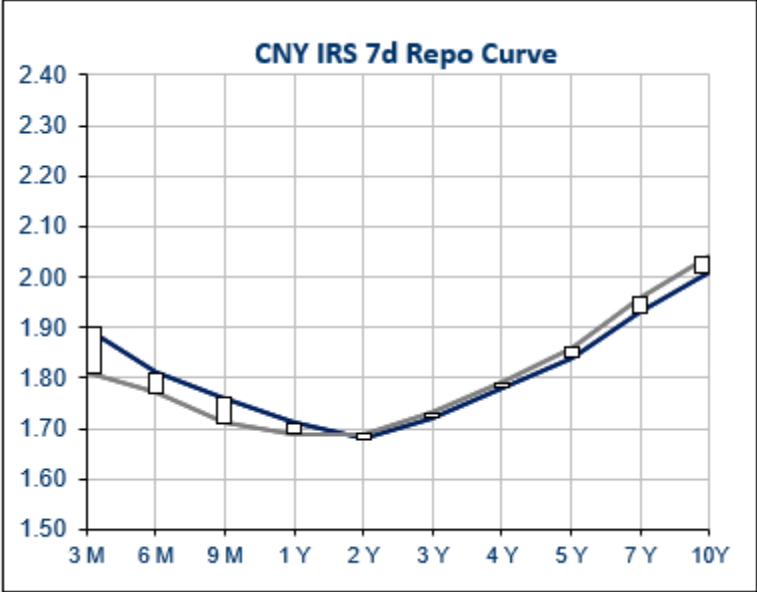
2024/10/9 星期三

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	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1. 9	9				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 81	4	6 M	1. 84	-	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 76	5	9 M	1. 8	5	9 M	1. 6	5									
1 Y	1. 71	2	1 Y	1. 77	5	1 Y	1. 6	5				1Y	1. 7	8			
2 Y	1. 68	-1	2 Y	1. 75	3	2 Y	1. 55	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 67	5			
3 Y	1. 72	-1	3 Y	1. 78	1	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 69	2			
4 Y	1. 78	-1	4 Y	1. 83	-				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 77	2			
5 Y	1. 84	-2	5 Y	1. 89	-2				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 81	1			
7 Y	1. 93	-3	7 Y	1. 98	-2				7 Y	1. 8	-						
10Y	2. 01	-3	10Y	2. 06	-2				10Y	1. 8	-						
7D REPO	2.05	15.00	3M Shibor	1. 841	0.10	O-N Shibor	1.618	10.90	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-9	-5			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-5	1	-4	5				
9M*1Y	-5	-3	-3	-	6M	3	-4	
1*2Y	-3	-3	-2	-2	9M	4	-	
1*3Y	1	-3	1	-4	1Y	6	3	
1*4Y	7	-3	6	-5	2Y	7	4	
1*5Y	13	-4	12	-7	3Y	6	2	
2*3Y	4	-	3	-2	4Y	5	1	
2*4Y	10	-	8	-3	5Y	5	-	
2*5Y	16	-1	14	-5				
3*4Y	6	-	5	-1				
3*5Y	12	-1	11	-3				
4*5Y	6	-1	6	-2				
5*7Y	9	-1	9	-				
5*10Y	17	-1	17	-				

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	33	9	43
今日	2	33	10	43



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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识/权益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、及时性或准确性等需求, 且可未经通知而进行修改, 所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang