



【2024-10-10】

中国央行今日进行 1500 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与昨日持平。今日有 2920 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 2.1%，与上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing: 1.8410%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.815%附近，后震荡下行，成交在 1.82%-1.79%区间附近，后稍微回调，成交到 1.81%附近，午盘报收 81/80.75。中午回来，5y repo 继续震荡下行，成交在 1.8125%-1.775%区间附近，报收 77.75/77.5。1y repo 全天震荡成交在 1.68%-1.70%区间附近，报收 68.75/68.25。其他期限，3m repo 成交在 1.855%-1.92%区间附近，6m repo 成交在 1.795%-1.79%区间附近，2y repo 成交在 1.66%-1.6375%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在 -6~-6.5bp 区间附近，1x2y repo 成交在 -3.75bp 点位，2x5y repo 成交在 15-14bp 区间附近，1x5y repo 成交在 11.75~9.5bp 附近，曲线走平，报收 9.5/9。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 75.25/73.75，5y shibor 成交在 1.85%附近，报收 83.75/82.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 10/7.5。基差方面，1y basis 报收 6.5/5.5，5y basis 报收 6/5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

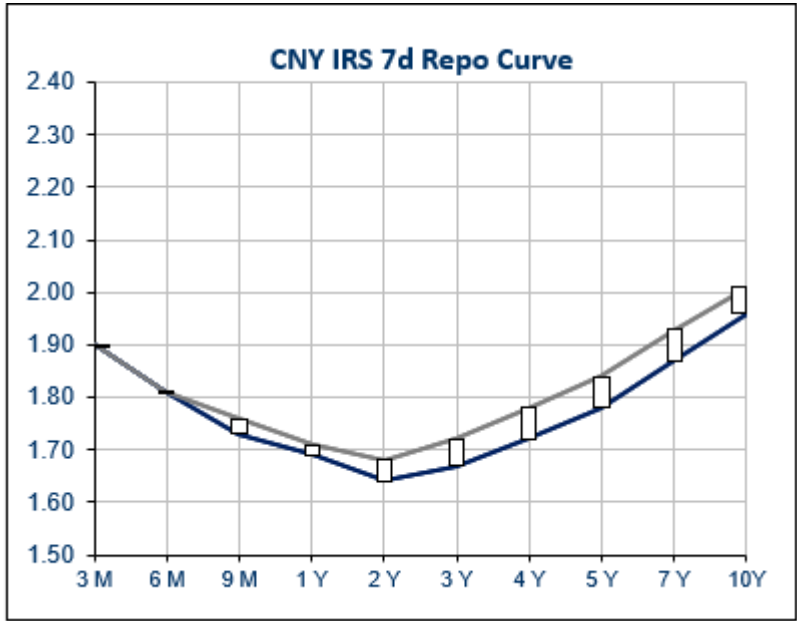
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/10/10 星期四

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	1.9	-				3 M	1.6	-						
6 M	1.81	-	6 M	1.83	-1	6 M	1.6	-						
9 M	1.73	-3	9 M	1.78	-2	9 M	1.55	-5						
1 Y	1.69	-2	1 Y	1.74	-3	1 Y	1.55	-5				1Y	1.67	-3
2 Y	1.64	-4	2 Y	1.7	-5	2 Y	1.55	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.62	-5
3 Y	1.67	-5	3 Y	1.74	-4	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.65	-4
4 Y	1.72	-6	4 Y	1.78	-5				4 Y	1.8	-	4Y	1.72	-5
5 Y	1.78	-6	5 Y	1.83	-6				5 Y	1.8	-	5Y	1.75	-6
7 Y	1.87	-6	7 Y	1.93	-5				7 Y	1.8	-			
10Y	1.96	-5	10Y	2.01	-5				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.10	5.00	3M Shibor	1.841	-	O-N Shibor	1.527	-9.10	1Y DEPO	1.50				

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

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	2	33	10	43
今日	2	36	9	45



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任何投资建议、投资建议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, 也不保证其准确性、及时性或及时性等要求, 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