



【2024-10-18】

中国央行今日开展 1084 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 942 亿元逆回购到期，当日实现净投放 142 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.85%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 1.8580%，与上一交易日上升 0.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.705%附近，后震荡上行成交在 1.705%-1.74%区间附近，午盘报收 73.75/73.5。中午回来，5y repo 小幅震荡上行，成交在 1.74%-1.7575%区间附近，报收 75.75/75.25。1y repo 全天震荡成交在 1.68%-1.695%区间附近，报收 69.25/69。其他期限，3m repo 成交在 1.88%区间附近，6m repo 成交在 1.80%附近，9m repo 成交在 1.735%区间附近，2y repo 成交在 1.625%-1.6275%区间附近，3y repo 成交在 1.6325%-1.655%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-6.5bp 点位，1x2 repo 成交在-06.5bp 点位，1x3 repo 成交在-05.25bp 点位，3x5y repo 成交在 8.75bp 点位，2x5y repo 成交在 10.25bp 点位，1x5y repo 成交在 03.75-06.5bp 区间附近，曲线走陡，报收 6.75/6.25。

Shibor 端，1y shibor 报收 75.25/73，5y shibor 报收 81.75/80.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 08/05.5。基差方面，1y basis 报收 6/4，5y basis 报收 6/5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

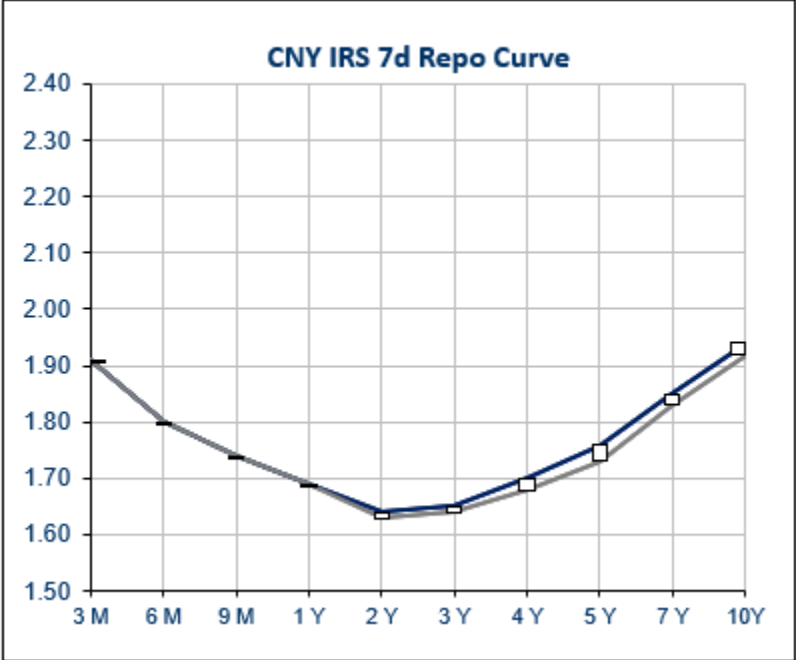
2024/10/18 星期五

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	1.91	-				3 M	1.6	-						
6 M	1.8	-	6 M	1.83	-	6 M	1.6	-						
9 M	1.74	-	9 M	1.78	-	9 M	1.5	-						
1 Y	1.69	-	1 Y	1.74	-	1 Y	1.5	-				1Y	1.68	-1
2 Y	1.64	1	2 Y	1.7	2	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.62	-
3 Y	1.65	1	3 Y	1.71	3	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.63	1
4 Y	1.7	2	4 Y	1.76	4				4 Y	1.8	-	4Y	1.71	-
5 Y	1.76	3	5 Y	1.81	5				5 Y	1.8	-	5Y	1.72	2
7 Y	1.85	2	7 Y	1.9	4				7 Y	1.8	-			
10Y	1.94	2	10Y	1.99	4				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.85	-3.00	3M Shibor	1.858	0.30	O-N Shibor	1.399	-2.60	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-11	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	-	-5	-				
9M*1Y	-5	-	-4	-	6M	3	-	
1*2Y	-5	1	-4	2	9M	4	-	
1*3Y	-4	1	-3	3	1Y	5	-	
1*4Y	1	2	2	4	2Y	6	1	
1*5Y	7	3	7	5	3Y	6	2	
2*3Y	1	-	1	1	4Y	6	2	
2*4Y	6	1	6	2	5Y	5	2	
2*5Y	12	2	11	3				
3*4Y	5	1	5	1				
3*5Y	11	2	10	2				
4*5Y	6	1	5	1				
5*7Y	9	-1	9	-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	0	38	9	47
今日	-1	37	8	45



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:
以上所发及附加的所有信息 (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、投资策略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