



【2024-10-29】

中国央行今日进行 3828 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 1584 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 2244 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing：1.90%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 1.8840%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.81%附近，后震荡下行，成交在 1.815%-1.80%区间附近，午盘报收 80.25/79.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.79%-1.805%区间附近，报收 80.25/79.75。1y repo 全天震荡成交在 1.7125%-1.7025%区间附近，报收 71.25/70.75。其他期限，1m repo 成交在 1.85%-1.855%区间附近，6m repo 成交在 1.7825%-1.78%区间附近，9m repo 成交在 1.7375%-1.735%区间附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-4.25~-4.5bp 区间附近，1x5y repo 成交在 8.5-10.25bp 区间附近，报收 9.25/8.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 75.5/74.75，5y shibor 报收 86.25/84.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 11.25/9.25。基差方面，1y basis 报收 4.75/4，5y basis 报收 6/5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

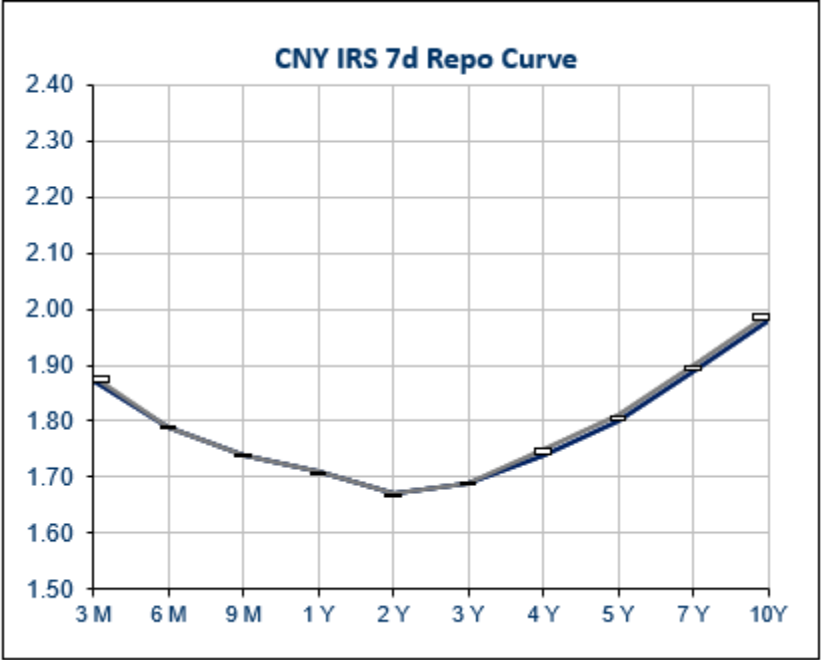
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/10/29 星期二

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. 87	-1				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 79	-	6 M	1. 84	1	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 74	-	9 M	1. 78	-1	9 M	1. 6	-									
1 Y	1. 71	-	1 Y	1. 75	-1	1 Y	1. 6	-				1Y	1. 7	-1			
2 Y	1. 67	-	2 Y	1. 72	-	2 Y	1. 6	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 65	-1			
3 Y	1. 69	-	3 Y	1. 74	-	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 67	-1			
4 Y	1. 74	-1	4 Y	1. 79	-2				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 75	-1			
5 Y	1. 8	-1	5 Y	1. 86	-1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 78	-1			
7 Y	1. 89	-1	7 Y	1. 95	-1				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 98	-1	10Y	2. 04	-1				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.90	-3.00	3M Shibor	1. 884	-	O-N Shibor	1.439	-5.60	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-8	1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-5	-	-6	-2				
9M*1Y	-3	-	-3	-	6M	5	1	
1*2Y	-4	-	-3	1	9M	4	-1	
1*3Y	-2	-	-1	1	1Y	4	-1	
1*4Y	3	-1	4	-1	2Y	5	-	
1*5Y	9	-1	11	-	3Y	5	-	
2*3Y	2	-	2	-	4Y	5	-1	
2*4Y	7	-1	7	-2	5Y	6	-	
2*5Y	13	-1	14	-1				
3*4Y	5	-1	5	-2				
3*5Y	11	-1	12	-1				
4*5Y	6	-	7	1				
5*7Y	9	-	9	-				
5*10Y	18	-	18	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	11	8	6	2	2	2	3
今日	11	9	7	4	3	3	4

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	0	36	6	46
今日	0	37	8	46



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:
以上所发及网站的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 且为保密的利/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国脉货币”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资策略任何交易策略相关的推介、定价、建议或诱导。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、及时性或完整性等要求, 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