



【2024-11-01】

中国央行今日进行 171 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 2926 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.79%，与上一交易日下降 8bp，3m shibor fixing: 1.8790%，与上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.7925%附近，后小幅震荡下行，成交在 1.795%-1.78%区间附近，午盘报收 78.25/77.75。中午回来，5y repo 继续震荡下行，成交在 1.775%-1.7675%区间附近，尾盘稍微回调，报收 77.25/76.75。1y repo 全天震荡成交在 1.695%-1.6675%区间附近，报收 67.25/67。其他期限，2m repo 成交在 1.83%点位，3m repo 成交在 1.84%-1.835%区间附近，6m repo 成交在 1.75%-1.7325%区间附近，2y repo 成交在 1.6525%-1.64%区间附近，3y repo 成交在 1.66%点位。曲线方面，6mx9m repo 成交在-3.5~-4bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-2.5~-2.25bp 区间附近，6mx1y repo 成交在-6.5bp 点位，3x5y repo 成交在 11bp 点位，2x5y repo 成交在 13bp 点位，1x5y repo 成交在 10bp 点位，报收 10.25/9.75。

Shibor 端，9m shibor 成交在 1.7475% 附近，1y shibor 成交在 1.7125%附近，报收 71.5/70.5，5y shibor 成交在 1.835%附近，5y shibor 报收 83.75/82.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 12.75/11.25。基差方面，1y basis 成交在 4.25bp 点位，报收 4.25/3.5，5y basis 成交在 6.5bp 点位，报收 6.5/5.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

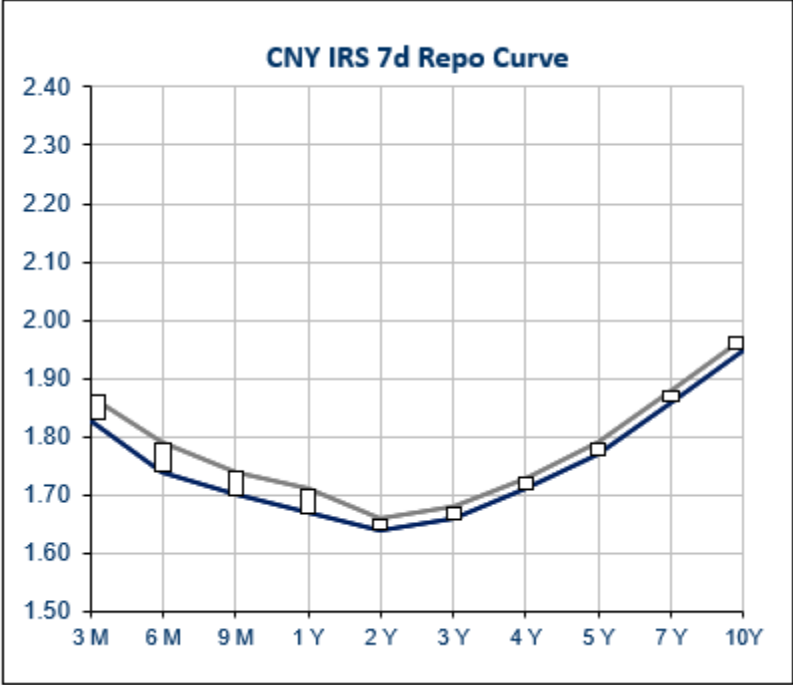
2024/11/1 星期五

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. 83	-4				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 74	-5	6 M	1. 81	-2	6 M	1. 6	15						
9 M	1. 7	-4	9 M	1. 75	-3	9 M	1. 6	15						
1 Y	1. 67	-4	1 Y	1. 71	-3	1 Y	1. 6	15				1Y	1. 66	-4
2 Y	1. 64	-2	2 Y	1. 67	-4	2 Y	1. 6	10	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 63	-2
3 Y	1. 66	-2	3 Y	1. 71	-2	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 65	-1
4 Y	1. 71	-2	4 Y	1. 77	-				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 73	-1
5 Y	1. 77	-2	5 Y	1. 83	-1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 75	-1
7 Y	1. 86	-2	7 Y	1. 93	-1				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 95	-2	10Y	2. 02	-1				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1. 79	-8.00	3M Shibor	1. 879	-0.50	O-N Shibor	1.36	-0.40	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-9	-1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-4	1	-6	-1				
9M*1Y	-3	-	-4	-	6M	7	3	
1*2Y	-3	2	-4	-1	9M	5	1	
1*3Y	-1	2	0	1	1Y	4	1	
1*4Y	4	2	6	3	2Y	3	-2	
1*5Y	10	2	12	2	3Y	5	-	
2*3Y	2	-	4	2	4Y	6	2	
2*4Y	7	-	10	4	5Y	6	1	
2*5Y	13	-	16	3				
3*4Y	5	-	6	2				
3*5Y	11	-	12	1				
4*5Y	6	-	6	-1				
5*7Y	9	-	10	-				
5*10Y	18	-	19	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	11	8	6	2	1	0	1
今日	11	8	6	2	1	0	1

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	36	6	46
今日	-2	38	7	47



联系人: Ruby Wu
邮箱: ruby@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、或者专用的信息。其知识“仅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任何投资建议。投资者在任何交易决策相关的报价、定价、建议或决策, 也不应作为决策依据。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