



【2024-10-22】

中国央行今日进行 1584 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 683 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.92%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.8690%，与上一交易日上升 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.7575%附近，后震荡上行，成交在 1.7575%-1.775%区间附近，午盘报收 77.5/77.25。中午回来，5y repo 继续震荡上行，成交在 1.77%-1.8025%区间附近，尾盘稍微回调，报收 80/79.5。1y repo 全天随长端震荡上行，成交在 1.70%-1.7375%区间附近，报收 73.5/73。其他期限，3m repo 成交在 1.93%-1.94%附近，6m repo 成交在 1.82%-1.8425%附近，9m repo 成交在 1.7575%-1.775%附近，2y repo 成交在 1.64%-1.675%附近，3y repo 成交在 1.665%-1.69%附近，4y repo 成交在 1.7375%-1.7425%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-6.25~-6.75bp 附近，1x2y repo 成交在-5.75bp 附近，3x4y repo 成交在 05bp 附近，4x5y repo 成交在 5.5-5.75bp 附近，2x5y repo 成交在 11.5bp 附近，1x5y repo 成交在 06-6.5bp 附近，报收 7/6.25。

Shibor 端，1y shibor 报收 80.5/79，5y shibor 成交在 1.8625%附近，报收 88/86.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 9/6。基差方面，1y basis 报收 7/6，5y basis 成交在 6.75bp 附近，报收 8/6.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

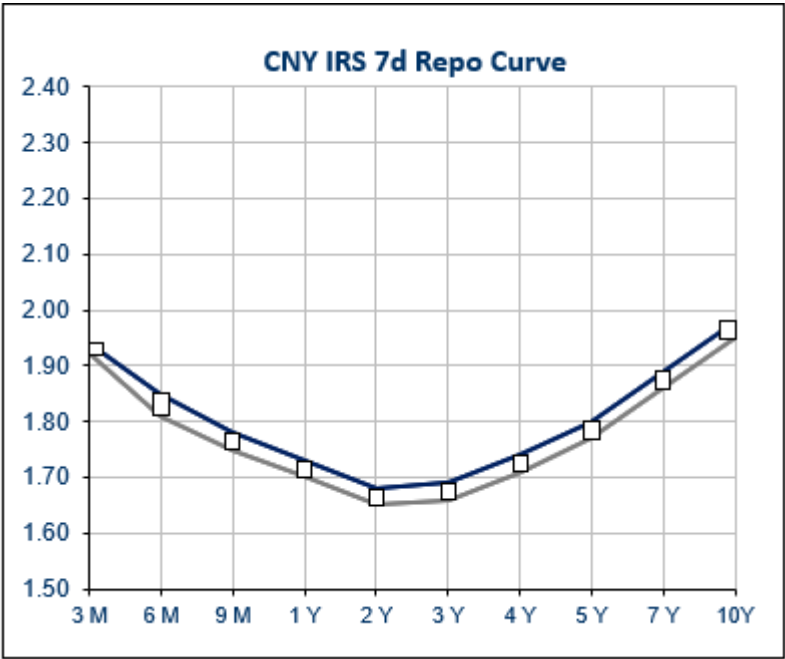
2024/10/22 星期二

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. 94	2				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 85	4	6 M	1. 89	5	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 78	3	9 M	1. 84	5	9 M	1. 6	-						
1 Y	1. 73	3	1 Y	1. 8	5	1 Y	1. 6	-				1Y	1. 73	3
2 Y	1. 68	3	2 Y	1. 75	6	2 Y	1. 6	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 67	4
3 Y	1. 69	3	3 Y	1. 76	5	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 68	3
4 Y	1. 74	3	4 Y	1. 82	5				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 76	3
5 Y	1. 8	3	5 Y	1. 87	5				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 78	4
7 Y	1. 89	3	7 Y	1. 96	5				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 98	3	10Y	2. 05	5				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.92	-	3M Shibor	1. 869	0.50	O-N Shibor	1.477	0.30	1Y DEPO	1.50				

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

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-1	36	8	44
今日	-2	35	8	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:
以上所有及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 并非投资建议/或者有担保的信息, 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”) 或其三方, “信息”不能也不应被解释为任何金融工具、投资建议或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、及时性或完整性等要求, 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处理。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang