



【2024-10-24】

中国央行今日进行 7989 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 1326 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 6663 亿元。早盘资金面均衡稍紧，下午转均衡。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.8790%，与上一交易日上升 0.6bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.795%附近，后震荡成交在 1.79%-1.805%区间附近，午盘报收 80.5/80.25。中午回来，5y repo 震荡上行，成交在 1.80%-1.8425%区间附近，报收 83.5/83。1y repo 全天震荡成交在 1.715%-1.745%区间附近，报收 74.5/74。曲线方面，1x5y repo 成交在 07.25-08.5bp 区间附近，曲线走陡，报收 9.25/8.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 81/80，5y shibor 报收 90.25/88。曲线方面，1x5y shibor 报收 9.5/7.75。基差方面，1y basis 报收 7/5.5，5y basis 报收 6.75/5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

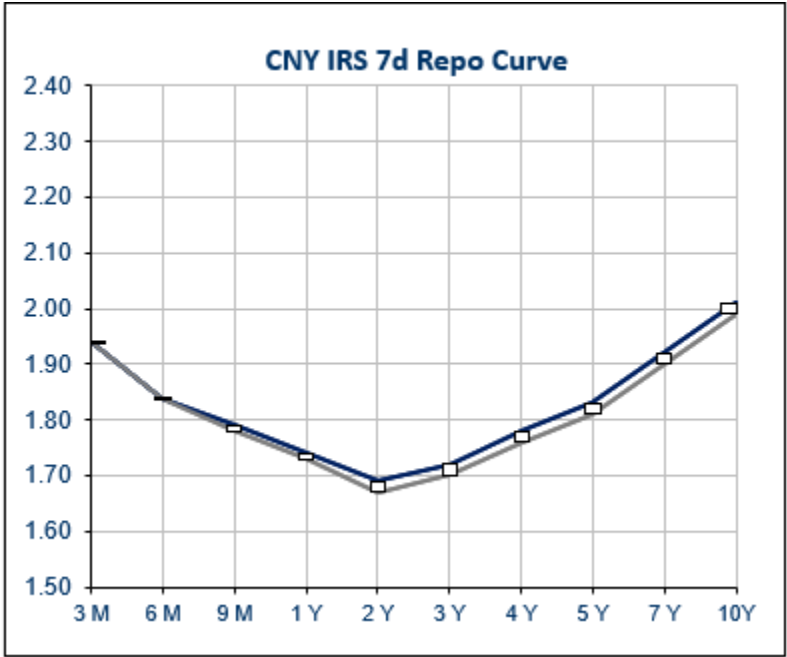
2024/10/24 星期四

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	1.94	-				3 M	1.6	-						
6 M	1.84	-	6 M	1.87	1	6 M	1.6	-						
9 M	1.79	1	9 M	1.84	1	9 M	1.6	-						
1 Y	1.74	1	1 Y	1.81	1	1 Y	1.6	-				1Y	1.74	1
2 Y	1.69	2	2 Y	1.75	-	2 Y	1.6	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.69	2
3 Y	1.72	2	3 Y	1.79	2	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.71	2
4 Y	1.78	2	4 Y	1.83	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.79	2
5 Y	1.83	2	5 Y	1.89	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.82	3
7 Y	1.92	2	7 Y	1.97	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.01	2	10Y	2.06	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-	3M Shibor	1.879	0.6-	O-N Shibor	1.49	-	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-10	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-5	1	-3	-				
9M*1Y	-5	-	-3	-	6M	3	1	
1*2Y	-5	1	-6	-1	9M	5	-	
1*3Y	-2	1	-2	1	1Y	7	-	
1*4Y	4	1	2	-1	2Y	6	-2	
1*5Y	9	1	8	-1	3Y	7	-	
2*3Y	3	-	4	2	4Y	5	-2	
2*4Y	9	-	8	-	5Y	6	-2	
2*5Y	14	-	14	-				
3*4Y	6	-	4	-2				
3*5Y	11	-	10	-2				
4*5Y	5	-	6	-				
5*7Y	9	-	8	-				
5*10Y	18	-	17	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	11	8	6	2	2	2	3
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	35	9	44
今日	-1	33	7	42



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任何金融工具、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