

收盘日评 银行间利率衍生品市场

常规报告系列



【2024-12-10】

中国人民银行今日开展 1416 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 513 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 903 亿元。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 1.93%，与上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing: 1.7480%，与上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.54%附近，后震荡下行，成交在 1.55%-1.52%区间附近，午盘报收 52.5/52。中午回来，5y repo 先下行成交到 1.5075%附近，后反弹上行，震荡成交在 1.5075%-1.5425%区间附近，尾盘又稍微回调，报收 53/52.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.52%-1.4825%区间附近，报收 50.75/50。其他期限，3m repo 成交在 1.72%附近，6m repo 成交在 1.575%附近，2y repo 成交在 1.475%-1.445%附近，3y repo 成交在 1.445%附近。曲线方面，6mx1y repo 成交在-9bp 附近，1x2y repo 成交在-5.5bp 附近，2x5y repo 成交在 7.5bp 附近，1x5y repo 成交在 3.5-2.5bp 附近，报收 3/2.5。

Shibor 端，1y shibor 报收 53.75/51，5y shibor 报收 57.5/54.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 4/2。基差方面，1y basis 报收 3/1，5y basis 报收 4.5/1。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

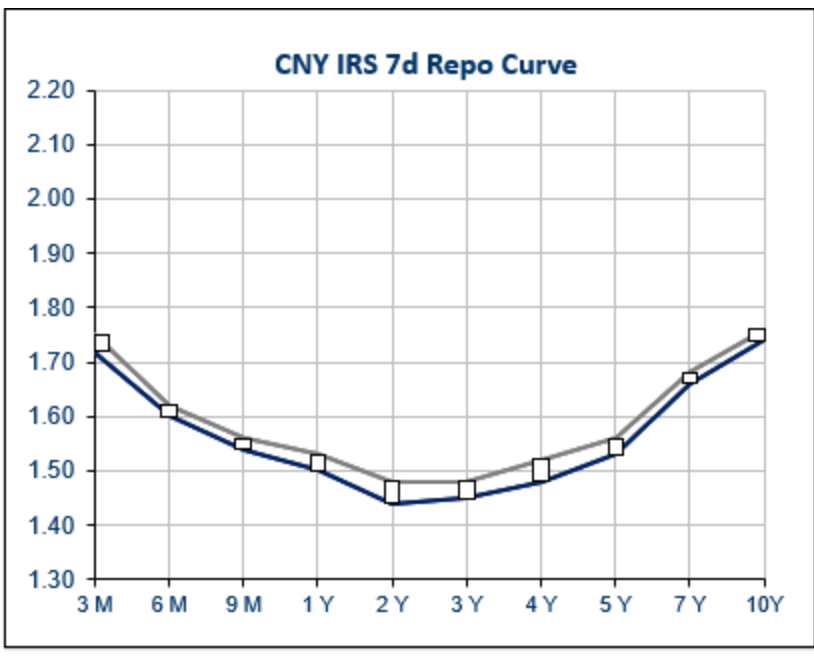
2024/12/10 星期二

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	1.72	-3				3 M	1.5	-10						
6 M	1.6	-2	6 M	1.66	-2	6 M	1.5	-10						
9 M	1.54	-2	9 M	1.58	-3	9 M	1.5	-10						
1 Y	1.5	-3	1 Y	1.53	-4	1 Y	1.4	-10				1Y	1.49	-3
2 Y	1.44	-4	2 Y	1.48	-3	2 Y	1.4	-10	2 Y	1.65	-	2Y	1.42	-4
3 Y	1.45	-3	3 Y	1.48	-3	3 Y	1.5	-10	3 Y	1.77	-	3Y	1.42	-3
4 Y	1.48	-4	4 Y	1.52	-3				4 Y	1.8	-	4Y	1.48	-3
5 Y	1.53	-3	5 Y	1.56	-2				5 Y	1.8	-	5Y	1.49	-3
7 Y	1.66	-2	7 Y	1.68	-2				7 Y	1.8	-			
10Y	1.74	-2	10Y	1.78	-2				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.93	5.00	3M Shibor	1.748	-0.50	O-N Shibor	1.47	-4.60	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO			
			Tenor	Mid	Δbp		
3M*6M	-12	1					
6M*9M	-6	-	-8	-1			
9M*1Y	-4	-1	-5	-1	6M	6	-
1*2Y	-6	-1	-5	1	9M	4	-1
1*3Y	-5	-	-5	1	1Y	3	-1
1*4Y	-2	-1	-1	1	2Y	4	1
1*5Y	3	-	3	2	3Y	3	-
2*3Y	1	1	0	-	4Y	4	1
2*4Y	4	-	4	-	5Y	3	1
2*5Y	9	1	8	1			
3*4Y	3	-1	4	-			
3*5Y	8	-	8	1			
4*5Y	5	1	4	1			
5*7Y	13	1	12	-			
5*10Y	21	1	22	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	3.06	3.04	3.03	3.01	3.01	3.01	3.02
今日	2.8	2.78	2.77	2.76	2.76	2.77	2.79

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-5	31	7	40
今日	-2	31	8	40



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:
 以上所提及的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识仅限于上海国联证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国联证券”) 或其三方。“信息”不能也不应被解释为任何投资建议、投资建议或任何交易策略相关的报价、出价、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, 且与未经通知而进行修改, 所有陈述和保证均按明确或声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang