



【2024-11-21】

中国央行今日开展 4701 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 3282 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 1419 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.84%，与上一交易日持平，3m shibor fixing: 1.8600%，与上一交易日上升 0.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.695%，成交在 1.7025%-1.685%区间附近，午盘报收 69.5/69.25。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.6925%-1.6825%区间附近，报收 68.75/68.25。1y repo 全天震荡成交在 1.665%-1.65%区间附近，报收 65.25/65。其他期限，1m repo 成交在 1.85%-1.855%附近，3m repo 成交在 1.86%-1.855%附近，6m repo 成交在 1.7725%-1.765%附近，9m repo 成交在 1.7025%区间附近，2y repo 成交在 1.595%-1.60%区间附近，3y repo 成交在 1.61%附近。曲线方面，1mx3m repo 成交在 0.5bp 附近，3mx6m repo 成交在 -9bp 到 -9.25bp 附近，6mx9m repo 成交在 -6.25bp 附近，6mx1y repo 成交在 -11bp 附近，9mx1y repo 成交在 -4.75bp 附近，2x5y repo 成交在 9.5bp 附近，1x5 repo 成交在 03.5-03.25bp 区间附近，报收 03.75/03.25。

Shibor 端，6m shibor 成交在 1.795%附近，2y shibor 成交在 1.6275%附近，1y shibor 报收 68.25/67.75，5y shibor 报收 73.25/72.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 05.5/04.5。基差方面，2y basis 成交 2.75bp, 1y basis 成交在 03bp，报收 3/2.5，5y basis 成交在 03.5bp 报收 5/3.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

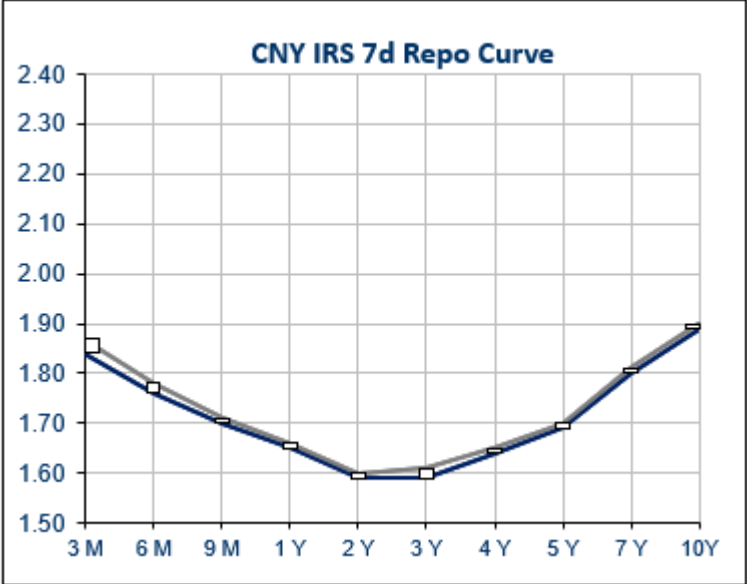
2024/11/21 星期四

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	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1.84	-3				3 M	1.6	-									
6 M	1.76	-2	6 M	1.8	-	6 M	1.6	-									
9 M	1.7	-1	9 M	1.73	-	9 M	1.6	-									
1 Y	1.65	-1	1 Y	1.68	-1	1 Y	1.5	-				1Y	1.65	-1			
2 Y	1.59	-1	2 Y	1.62	-1	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.58	-1			
3 Y	1.59	-2	3 Y	1.63	-2	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.58	-1			
4 Y	1.64	-1	4 Y	1.67	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.65	-1			
5 Y	1.69	-1	5 Y	1.73	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.65	-2			
7 Y	1.8	-1	7 Y	1.85	-1				7 Y	1.8	-						
10Y	1.89	-1	10Y	1.94	-1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.84	-	3M Shibor	1.86	0.30	O-N Shibor	1.455	-1.50	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-8	1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	1	-7	-				
9M*1Y	-5	-	-5	-1	6M	4	2	
1*2Y	-6	-	-6	-	9M	3	1	
1*3Y	-6	-1	-5	-1	1Y	3	-	
1*4Y	-1	-	-1	-1	2Y	3	-	
1*5Y	4	-	5	-	3Y	4	-	
2*3Y	0	-1	1	-1	4Y	3	-1	
2*4Y	5	-	5	-1	5Y	4	-	
2*5Y	10	-	11	-				
3*4Y	5	1	4	-				
3*5Y	10	1	10	1				
4*5Y	5	-	6	1				
5*7Y	11	-	12	-				
5*10Y	20	-	21	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	12	9	7	4	3	4	6
今日	12	9	7	4	3	4	6

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-3	40	12	51
今日	-5	39	12	50



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, 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”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资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处理。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang