



【2024-11-19】

中国央行今日进行 2883 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 1255 亿元 7 天期逆回购到期。资金面整体均衡偏紧，尾盘转松。7d repo fixing: 1.84%，与上一交易日下降 1bp，3m shibor fixing: 1.8560%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.7275%附近，后震荡下行，成交在 1.73%-1.7025%区间附近，午盘报收 70.5/70.25。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.71%-1.70%区间附近，报收 70/69.75。1y repo 全天震荡成交在 1.6825%-1.66%区间附近，报收 66.5/66。其他期限，6m repo 成交在 1.7675%附近，9m repo 成交在 1.72%-1.7225%附近，2y repo 成交在 1.6275%-1.61%附近，3y repo 成交在 1.615%-1.61%附近，4y repo 成交在 1.6725%-1.6525%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-4.75bp 附近，1x2y repo 成交在-6bp 附近，3x4y repo 成交在 4.5-4.75bp 附近，3x5y repo 成交在 9.75bp 附近，4x5y repo 成交在 4.5bp 附近，1x5y repo 成交在 4.5-4bp 附近，报收 4.25/3.75。

Shibor 端，6m shibor 成交在 1.8025%-1.7975%附近，1y shibor 成交在 1.695%附近，报收 68.75/68，5y shibor 成交在 1.755%-1.75%附近，报收 74.5/73.25。曲线方面，1x5y shibor 成交在 6bp 附近，报收 6/5。基差方面，1y basis 报收 1.25/1.5，5y basis 成交在 3.5bp 附近，报收 4/3。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

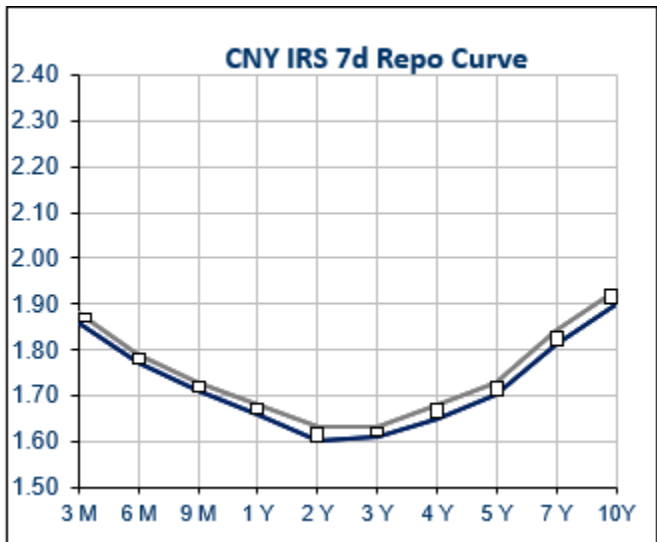
2024/11/19 星期二

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	1.86	-2				3 M	1.6	-						
6 M	1.77	-2	6 M	1.8	-2	6 M	1.6	-						
9 M	1.71	-2	9 M	1.72	-2	9 M	1.6	-						
1 Y	1.66	-2	1 Y	1.68	-3	1 Y	1.5	-				1Y	1.66	-2
2 Y	1.6	-3	2 Y	1.63	-4	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.59	-2
3 Y	1.61	-2	3 Y	1.64	-3	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.59	-3
4 Y	1.65	-3	4 Y	1.69	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.66	-2
5 Y	1.7	-3	5 Y	1.74	-3				5 Y	1.8	-	5Y	1.67	-3
7 Y	1.81	-3	7 Y	1.86	-3				7 Y	1.8	-			
10Y	1.9	-3	10Y	1.95	-3				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.84	-1.00	3M Shibor	1.856	-	O-N Shibor	1.48	1.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
					Tenor	Mid	Δbp	
3M*6M	-9	-						
6M*9M	-6	-	-8	-				
9M*1Y	-5	-	-4	-1	6M	3	-	
1*2Y	-6	-1	-5	-1	9M	1	-	
1*3Y	-5	-	-4	-	1Y	2	-1	
1*4Y	-1	-1	1	1	2Y	3	-1	
1*5Y	4	-1	6	-	3Y	3	-1	
2*3Y	1	1	1	1	4Y	4	1	
2*4Y	5	-	6	2	5Y	4	-	
2*5Y	10	-	11	1				
3*4Y	4	-1	5	1				
3*5Y	9	-1	10	-				
4*5Y	5	-	5	-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	-5	39	10	48
今日	-3	40	12	50



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:

以上所发及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 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、建议或诱导。“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, 所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang