



【2024-11-22】

 中国人民银行今日开展 6351 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 9810 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 3459 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.82%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.8600%，与上一交易日持平。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.68%，震荡上行后回落，成交在 1.6925%-1.68%区间附近，午盘报收 68.75/68.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.69%-1.6825%区间附近，报收 68.5/68.25。1y repo 全天震荡成交在 1.64%-1.6475%区间附近，报收 64.5/64.25。其他期限，1m repo 成交在 1.84% 附近，3m repo 成交在 1.8325%-1.84%区间附近，6m repo 成交在 1.7575%-1.75%区间附近，9m repo 成交在 1.69%-1.6925%区间附近，4y repo 成交在 1.635%附近，3y repo 成交在 1.5925%-1.5975%附近。曲线方面，3mx9m repo 成交在-14.5bp 附近，3mx6m repo 成交在-8.75bp 附近，6mx9m repo 成交在-6.5bp 附近，6mx1y repo 成交在-10.75bp 到-11bp 附近，9mx1y repo 成交在--4.5bp 到-4.75bp 附近，3x5y repo 成交在 9bp-9.25bp 附近，3x4y repo 成交在 04.25bp 附近，1x5 repo 成交在 03.75-04.25bp 区间附近，报收 04.25/04。

 Shibor 端，1y shibor 成交在 1.6775%附近，报收 67.75/67.25，5y shibor 报收 72.75/72。曲线方面，1x5y shibor 报收 05/04.25。基差方面，1y basis 成交 03.25bp, 1y basis 报收 3.5/2.75，5y basis 报收 4.5/3.5。

 LPR 端，1y LPR_1y 成交在 3.07%附近，报收 06.75/04.5

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

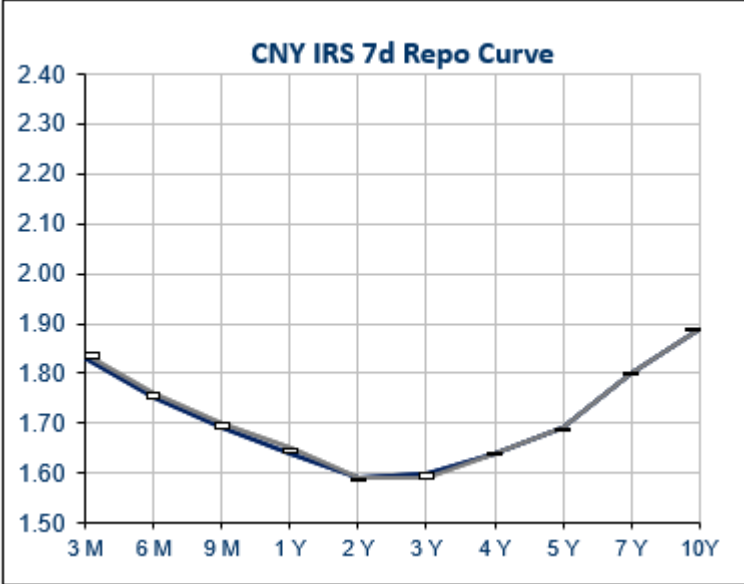
2024/11/22 星期五

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. 83	-1				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 75	-1	6 M	1. 8	-	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 69	-1	9 M	1. 73	-	9 M	1. 6	-						
1 Y	1. 64	-1	1 Y	1. 68	-	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 64	-1
2 Y	1. 59	-	2 Y	1. 62	-	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 57	-1
3 Y	1. 6	1	3 Y	1. 64	1	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 58	-
4 Y	1. 64	-	4 Y	1. 68	1				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 65	-
5 Y	1. 69	-	5 Y	1. 72	-1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 65	-
7 Y	1. 8	-	7 Y	1. 85	-				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 89	-	10Y	1. 94	-				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.82	-2.00	3M Shibor	1. 86	-	O-N Shibor	1.456	0.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-8	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	-	-7	-				
9M*1Y	-5	-	-5	-	6M	5	1	
1*2Y	-5	1	-6	-	9M	4	1	
1*3Y	-4	2	-4	1	1Y	4	1	
1*4Y	0	1	0	1	2Y	3	-	
1*5Y	5	1	4	-1	3Y	4	-	
2*3Y	1	1	2	1	4Y	4	1	
2*4Y	5	-	6	1	5Y	3	-1	
2*5Y	10	-	10	-1				
3*4Y	4	-1	4	-				
3*5Y	9	-1	8	-2				
4*5Y	5	-	4	-2				
5*7Y	11	-	13	1				
5*10Y	20	-	22	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	12	9	7	4	3	4	6
今日	8	5	4	2	2	2	3

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-5	39	12	50
今日	-4	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:
以上所提及到的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，并非投资建议/或者有效的信息，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，也不保证其真实性、时效性或准确性等要求，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