



【2024-12-05】

中国央行公开市场今日开展 373 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率持平 1.50%。今日有 1903 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 1530 亿元。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing：1.82%，与上一交易日上升 3bp，3m shibor fixing: 1.7620%，与上一交易日下降 1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.595%附近，后震荡成交在 1.60%-1.59%区间附近，午盘报收 59.25/59。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.6025%-1.5875%区间附近，报收 60.25/60。1y repo 震荡成交在 1.575%-1.56%区间附近，报收 57.75/57.25。其他期限，6m repo 成交在 1.6575%附近，9m repo 成交在 1.6025%-1.61%区间附近，2y repo 成交在 1.5075%-1.5125%区间附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-4 到-3.5bp 附近，6mx1y repo 成交在-9bp 附近，1x2y repo 成交在-5.5bp 到-5.75bp 附近，1x5y repo 成交在 02.5-02.75bp 附近，曲线稍微走平，报收 2.75/2.25。

Shibor 端，1y shibor 报收 59.5/58.75，5y shibor 成交在 1.61% 附近，报收 62/61。曲线方面，1x5y shibor 报收 3/1.5。基差方面，1y basis 报收 02.25/01.5，5y basis 成交在 02bp 点位，报收 02.5/01.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

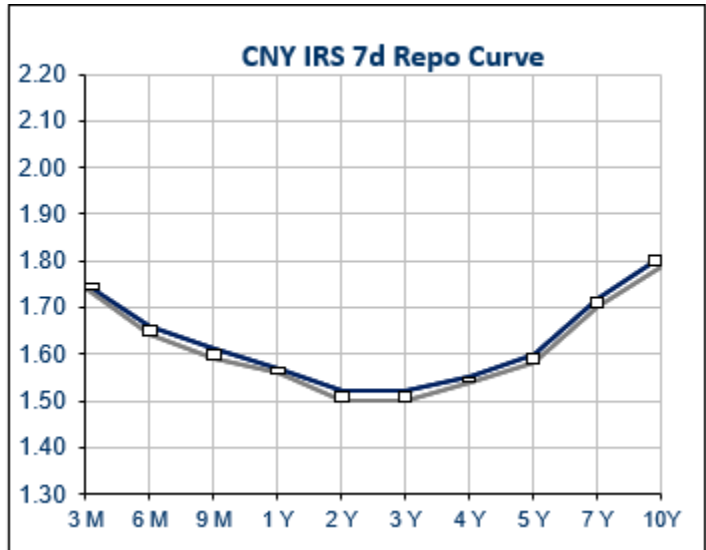
2024/12/5 星期四

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	1.75	1				3 M	1.6	-									
6 M	1.66	2	6 M	1.7	-	6 M	1.6	-									
9 M	1.61	2	9 M	1.64	1	9 M	1.6	-									
1 Y	1.57	1	1 Y	1.59	1	1 Y	1.5	-				1Y	1.56	2			
2 Y	1.52	2	2 Y	1.53	-	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.49	2			
3 Y	1.52	2	3 Y	1.53	-	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.49	2			
4 Y	1.55	1	4 Y	1.58	2				4 Y	1.8	-	4Y	1.55	2			
5 Y	1.6	2	5 Y	1.62	2				5 Y	1.8	-	5Y	1.56	2			
7 Y	1.72	2	7 Y	1.75	2				7 Y	1.8	-						
10Y	1.81	2	10Y	1.84	2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.82	3.00	3M Shibor	1.762	-1.00	O-N Shibor	1.479	9.80	1Y DEPO	1.50							

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

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	38	10	46
今日	-4	35	9	43



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”) 仅提供供参考, 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