



【2024-12-03】

中国央行公开市场今日开展 513 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率持平 1.50%。今日 2993 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing：1.75%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 1.7950%，与上一交易日下降 3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.5825%附近，后震荡上行，成交在 1.5825%-1.6025%区间附近，又震荡下行，最低成交到 1.59%附近，午盘报收 59.5/59.25。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.605%-1.595%区间附近，报收 59.75/59.5。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.535%-1.55%区间附近，报收 54/53.75。其他期限，3m repo 成交在 1.71%附近，6m repo 成交在 1.6225%-1.615%区间附近，9m repo 成交在 1.5825%-1.5775%区间附近，2y repo 成交在 1.50%-1.5025%区间附近，3y repo 成交在 1.505%-1.51%区间附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-4--4.25bp 区间附近，6mx1y repo 成交在-7.75--7.5bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-3.75--3.25bp 区间附近，1x2y repo 成交在-4.25bp 附近，1x5y repo 成交在 5bp 附近，报收 5.5/5.25。

Shibor 端，1y shibor 报收 58.5/57.75，5y shibor 报收 62/60.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 4.5/2.5。基差方面，1y basis 报收 4.25/3.5，5y basis 报收 2.75/1。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

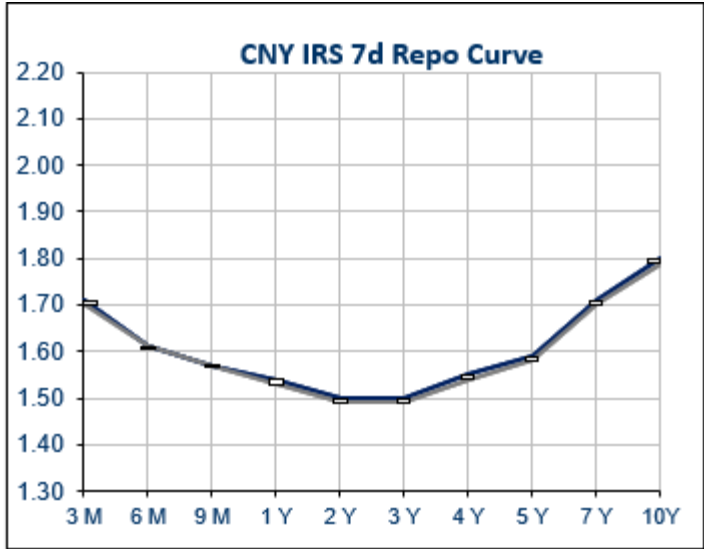
2024/12/3 星期二

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	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1. 71	1				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 61	-	6 M	1. 7	1	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 57	-	9 M	1. 63	1	9 M	1. 6	-									
1 Y	1. 54	1	1 Y	1. 58	1	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 53	1			
2 Y	1. 5	1	2 Y	1. 53	-	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 47	1			
3 Y	1. 5	1	3 Y	1. 53	-1	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 48	2			
4 Y	1. 55	1	4 Y	1. 57	-				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 54	2			
5 Y	1. 59	1	5 Y	1. 61	-				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 55	2			
7 Y	1. 71	1	7 Y	1. 74	-				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 8	1	10Y	1. 83	-				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.75	2.00	3M Shibor	1. 795	-3.00	O-N Shibor	1.337	-7.70	1Y DEPO	1.50							

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

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	8	5	4	2	2	2	3
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	-1	40	11	49
今日	-1	40	11	48



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting.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任何投资建议、投资建议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, 也不保证其准确性、及时性或及时性等要求, 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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang