

常规报告系列

收盘日评 银行间利率衍生品市场

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-11-13】

中国央行今日进行 2330 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平。今日 173 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.90%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 1.8590%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.68%附近，后小幅震荡，成交在 1.68%-1.69%区间附近，午盘报收 68.75/68.5。中午回来，5y repo 稍微震荡上行，成交在 1.69%-1.7075%区间附近，报收 70.75/70.25。1y repo 全天震荡成交在 1.6525%-1.665%区间附近，报收 66.5/66.25。其他期限，3m repo 成交在 1.855%-1.86%附近，6m repo 成交在 1.77%-1.7775%附近，9m repo 成交在 1.7075%-1.71%附近，2y repo 成交在 1.59%-1.595%附近，3y repo 成交在 1.615%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在-8.25~-9bp 区间附近，3mx9m repo 成交在-15~-16bp 区间附近，6mx9m repo 成交在-6~-6.75bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-5.25bp 附近，1x3y repo 成交在-4.75bp 附近，2x5y repo 成交在 9.75bp 附近，5x7y repo 成交在 7.5bp 附近，1x5y repo 成交在 3-4.25bp 附近，曲线走陡，报收 4.5/4.25。

Shibor 端，1y shibor 报收 69/67.75，5y shibor 报收 76/73.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 8.25/4.75。基差方面，1y basis 报收 2.75/1.5，5y basis 报收 5/3。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

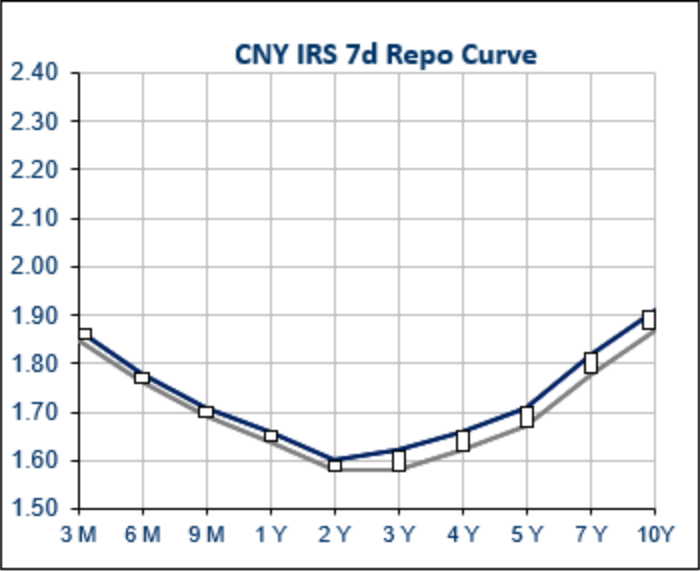
2024/11/13 星期三

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. 87	2				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 78	2	6 M	1. 8	-	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 71	2	9 M	1. 73	1	9 M	1. 6	-						
1 Y	1. 66	2	1 Y	1. 68	1	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 66	3
2 Y	1. 6	2	2 Y	1. 63	2	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 59	3
3 Y	1. 62	4	3 Y	1. 65	3	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 59	2
4 Y	1. 66	4	4 Y	1. 7	4				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 66	3
5 Y	1. 71	4	5 Y	1. 75	4				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 67	4
7 Y	1. 82	4	7 Y	1. 87	4				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 91	4	10Y	1. 96	4				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.90	-	3M Shibor	1. 859	-	O-N Shibor	1.465	-6.00	1Y DEPO	1.50				

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

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	12	9	8	4	4	5	7
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	1	42	14	52
今日	-2	40	11	49



联系人: Ruby Hu
邮箱: ruby.hu@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, 且为保密的利/或者专用的信息。其知识“仅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报价、出价、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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN