



【2024-12-06】

中国央行今日进行 1909 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平。因今日有 4790 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2881 亿元。资金面整体偏紧。7d repo fixing: 1.85%，与上一交易日上升 3bp，3m shibor fixing: 1.7550%，与上一交易日下降 0.7bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.60%附近，后震荡成交在 1.595%-1.60%区间附近，午盘报收 60/59.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.6025%-1.595%区间附近，报收 60.5/60.25。1y repo 震荡成交在 1.5825%-1.5725%区间附近，报收 58.25/58。其他期限，9m repo 成交在 1.61%-1.62%区间附近，2y repo 成交在 1.5225%附近，3y repo 成交在 1.5225%附近。曲线方面，6mx1y repo 成交在-08.75bp 点位，9mx1y repo 成交在-3.75bp 点位，2x3y repo 成交在 00bp 点位，1x5y repo 成交在 02.25bp 点位，报收 2.5/2。

Shibor 端，1y shibor 报收 59.5/58.5，5y shibor 成交在 1.62% 附近，报收 63/61.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 4.5/2.25。基差方面，1y basis 报收 1.5/0.5，5y basis 成交在 02bp 点位，报收 02.75/01.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

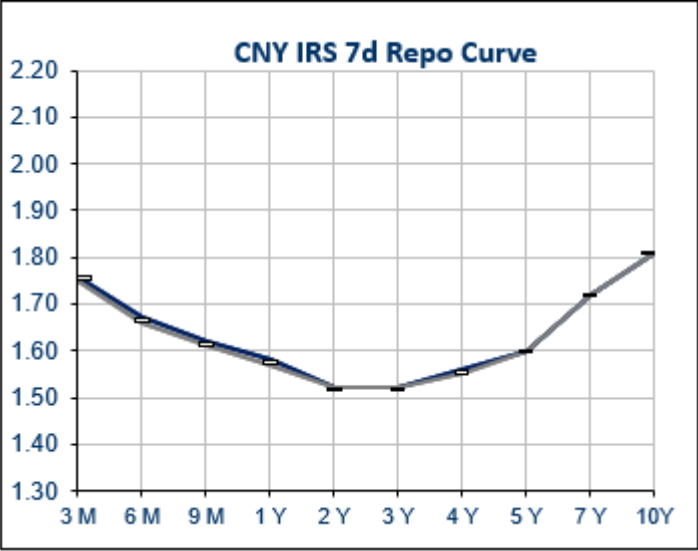
2024/12/6 星期五

Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd													ONSHORE IRS	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. 76	1				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 67	1	6 M	1. 7	-	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 62	1	9 M	1. 63	-1	9 M	1. 6	-									
1 Y	1. 58	1	1 Y	1. 59	-	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 58	2			
2 Y	1. 52	-	2 Y	1. 53	-	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 5	1			
3 Y	1. 52	-	3 Y	1. 53	-	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 49	-			
4 Y	1. 56	1	4 Y	1. 59	1				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 55	-			
5 Y	1. 6	-	5 Y	1. 63	1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 56	-			
7 Y	1. 72	-	7 Y	1. 75	-				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 81	-	10Y	1. 84	-				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.85	3.00	3M Shibor	1. 755	-0.70	O-N Shibor	1.478	-0.10	1Y DEPO	1.50							

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

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	-4	35	9	43
今日	-3	35	10	44



。

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:

以上所述及附带的任何信息 (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”不应也不应被解释为与任何金融工具、股票或任何交易策略相关的推介、定价、建议或要求。“信息”不可作为投资决策, 也不保证其准确性、及时性或完整性等要求, 且可未经通知而进行修改, 所有陈述和保证均按所述免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang