



【2024-12-04】

中国央行公开市场今日开展 413 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率持平 1.50%。今日有 2683 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.79%，与上一交易日上升 4bp，3m shibor fixing: 1.7720%，与上一交易日下降 2.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.5875%附近，后震荡成交在 1.5825%-1.595%区间附近，午盘报收 59.25/59。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.59%-1.58%区间附近，报收 58.5/58.25。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.54%-1.56%区间附近，报收 55.75/55.5。其他期限，3m repo 成交在 1.72% 附近，6m repo 成交在 1.6275%-1.635%附近，9m repo 成交在 1.5925%-1.5875%附近，2y repo 成交在 1.495%-1.50%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-3.5bp 附近，6mx1y repo 成交在-8.25bp 附近，1x2y repo 成交在-5bp 附近，1x5y repo 成交在 4.75-3bp 附近，曲线稍微走平，报收 3.25/2.75。

Shibor 端，1y shibor 报收 58/57.5，5y shibor 报收 62.5/59.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 3.75/1.5。基差方面，1y basis 报收 2.75/2，5y basis 报收 3/1.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

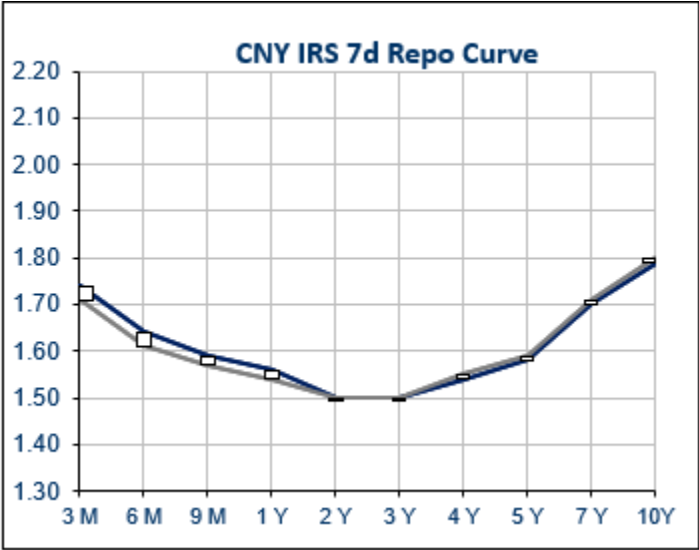
2024/12/4 星期三

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	1.74	3				3 M	1.6	-									
6 M	1.64	3	6 M	1.7	-	6 M	1.6	-									
9 M	1.59	2	9 M	1.63	-	9 M	1.6	-									
1 Y	1.56	2	1 Y	1.58	-	1 Y	1.5	-				1Y	1.54	1			
2 Y	1.5	-	2 Y	1.53	-	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.47	-			
3 Y	1.5	-	3 Y	1.53	-	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.47	-1			
4 Y	1.54	-1	4 Y	1.56	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.53	-1			
5 Y	1.58	-1	5 Y	1.6	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.54	-1			
7 Y	1.7	-1	7 Y	1.73	-1				7 Y	1.8	-						
10Y	1.79	-1	10Y	1.82	-1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.79	4.00	3M Shibor	1.772	-2.30	O-N Shibor	1.381	4.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-10	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-5	-1	-7	-				
9M*1Y	-3	-	-5	-	6M	6	-3	
1*2Y	-6	-2	-5	-	9M	4	-2	
1*3Y	-6	-2	-5	-	1Y	2	-2	
1*4Y	-2	-3	-2	-1	2Y	3	-	
1*5Y	2	-3	2	-1	3Y	3	-	
2*3Y	0	-	0	-	4Y	2	-	
2*4Y	4	-1	3	-1	5Y	2	-	
2*5Y	8	-1	7	-1				
3*4Y	4	-1	3	-1				
3*5Y	8	-1	7	-1				
4*5Y	4	-	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	-1	40	11	48
今日	-2	38	10	46



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, 所有前述和保证均被明确放弃声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang