



【2024-12-09】

中国央行公开市场今日开展 471 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率持平 1.50%。今日有 333 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 1.88%，与上一交易日上升 3bp，3m shibor fixing: 1.7530%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.60%附近，上午震荡成交在 1.5975%-1.6025%区间附近，午盘报收 60/59.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.5625%-1.605%区间附近，报收 56.5/56。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.535%-1.5875%区间附近，报收 54.25/53。其他期限，3m repo 成交在 1.7775%-1.755%区间附近，6m repo 成交在 1.6825%-1.645%区间附近，9m repo 成交在 1.6125%-1.5825%区间附近，2y repo 成交在 1.5275%-1.50%区间附近，4y repo 成交在 1.5575%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-4.75bp 附近，6mx1y repo 成交在-8.5--8bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-3.5--3.25bp 附近，1x2y repo 成交在-5.75bp 附近，1x5y repo 成交在 02-03.5bp 附近，报收 3.25/3。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.595%附近，报收 57.25/55.5，5y shibor 报收 60.75/57.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 5.25/5.5。基差方面，1y basis 报收 3.75/1.75，5y basis 报收 4.25/0。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

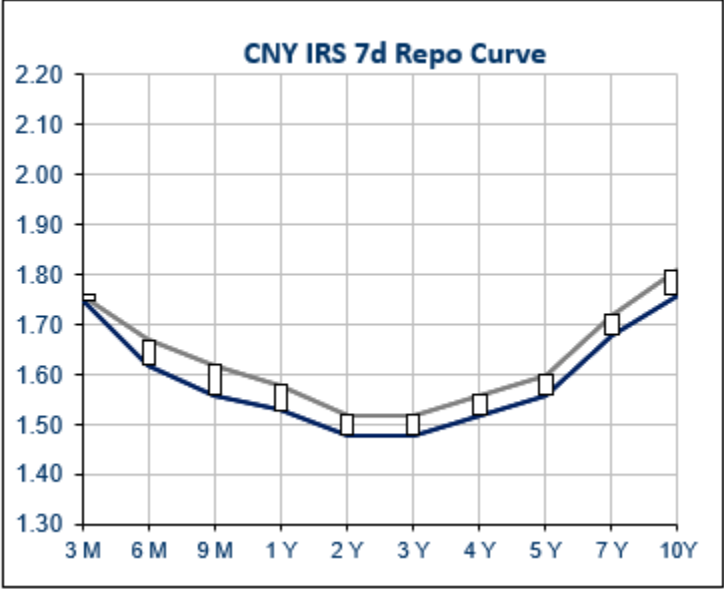
2024/12/9 星期一

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. 62	-5	6 M	1. 68	-2	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 56	-6	9 M	1. 61	-2	9 M	1. 6	-									
1 Y	1. 53	-5	1 Y	1. 57	-2	1 Y	1. 5	-							1Y	1. 52	-6
2 Y	1. 48	-4	2 Y	1. 51	-2	2 Y	1. 5	-				2 Y	1. 65	-	2Y	1. 46	-4
3 Y	1. 48	-4	3 Y	1. 51	-2	3 Y	1. 6	-				3 Y	1. 77	-	3Y	1. 45	-4
4 Y	1. 52	-4	4 Y	1. 55	-4							4 Y	1. 8	-	4Y	1. 51	-4
5 Y	1. 56	-4	5 Y	1. 58	-5							5 Y	1. 8	-	5Y	1. 52	-4
7 Y	1. 68	-4	7 Y	1. 7	-5							7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 76	-5	10Y	1. 8	-4							10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.88	3.00	3M Shibor	1. 753	-0.20	O-N Shibor	1.516	3.80	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-13	-4			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	-1	-7	-				
9M*1Y	-3	1	-4	-	6M	6	3	
1*2Y	-5	1	-6	-	9M	5	4	
1*3Y	-5	1	-6	-	1Y	4	3	
1*4Y	-1	1	-2	-2	2Y	3	2	
1*5Y	3	1	1	-3	3Y	3	2	
2*3Y	0	-	0	-	4Y	3	-	
2*4Y	4	-	4	-2	5Y	2	-1	
2*5Y	8	-	7	-3				
3*4Y	4	-	4	-2				
3*5Y	8	-	7	-3				
4*5Y	4	-	3	-1				
5*7Y	12	-	12	-				
5*10Y	20	-1	22	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	-3	35	10	44
今日	-5	31	7	40



联系人: Ruby Wu
邮箱: ruby@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”) 仅供参考, 不作为投资建议。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”) 或其三方。“信息”不能也不应被解释为任何投资建议、报价、建议或承诺。“信息”不可作为决策依据, 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。所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang