



【2024-12-31】

中国央行今日开展 1577 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 641 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 936 亿元。中国 12 月官方制造业 PMI 50.1，前值 50.3。资金面整体紧张，尾盘转松。7d repo fixing: 2.20%，与上一交易日相比无变化，3m shibor fixing 1.6855%，与上一交易日上升 0.05bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.4325%附近，震荡成交在 1.4325%-1.4425%区间附近，午盘报收 44.25/44。中午回来，5y repo 成交到 1.44%附近，震荡成交在 1.43%-1.445%区间附近，报收 43.5/43.25。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.455%-1.4725%区间附近，报收 46.5/46.25。其他期限，3m repo 成交在 1.68%-1.685%附近，2y repo 成交在 1.3975%-1.4025%附近。曲线方面，6mx1y repo 成交在-11.5bp 附近，1x2y repo 成交在-06 至 -05.75bp 附近，2x5y repo 成交在 03.75 至 03bp 附近，9mx5y repo 成交在-07bp 附近，1x5y repo 成交-02 至-03bp 附近，报收-2.75/-03。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.435%附近，报收 44.5/43.75，5y shibor 成交在 1.43%附近，报收 43/40.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 1.0/-1.25。基差方面，1y basis 成交在-02.5bp 附近，报收-02/-03，5y basis 成交在-0.5bp 附近，报收-0.5/-03。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

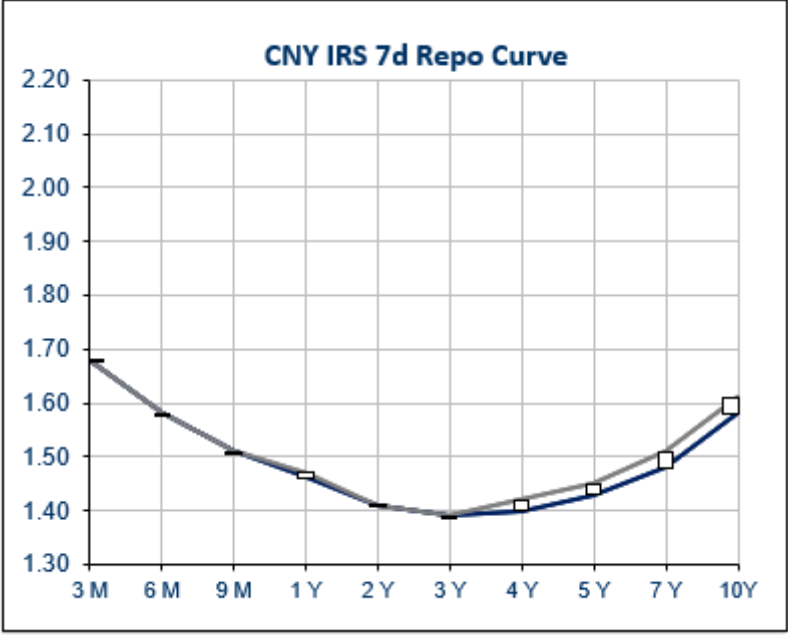
2024/12/31 星期二

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			
3 M	1.68	-				3 M	1.59	9									
6 M	1.58	-	6 M	1.57	-	6 M	1.59	9									
9 M	1.51	-	9 M	1.49	-	9 M	1.59	9									
1 Y	1.46	-1	1 Y	1.44	-	1 Y	1.49	9				1Y	1.47	-			
2 Y	1.41	-	2 Y	1.4	-	2 Y	1.48	8	2 Y	1.65	-	2Y	1.38	-1			
3 Y	1.39	-	3 Y	1.38	-1	3 Y	1.5	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.37	1			
4 Y	1.4	-2	4 Y	1.39	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.39	-1			
5 Y	1.43	-2	5 Y	1.42	-3				5 Y	1.8	-	5Y	1.4	-2			
7 Y	1.48	-3	7 Y	1.47	-4				7 Y	1.8	-						
10Y	1.58	-3	10Y	1.58	-3				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.20	-	3M Shibor	1.6855	0.05	O-N Shibor	1.454	8.70	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-10	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-7	-	-8	-				
9M*1Y	-5	-1	-5	-	6M	-1	-	
1*2Y	-5	1	-4	-	9M	-2	-	
1*3Y	-7	1	-6	-1	1Y	-2	1	
1*4Y	-6	-1	-5	-2	2Y	-1	-	
1*5Y	-3	-1	-2	-3	3Y	-1	-1	
2*3Y	-2	-	-2	-1	4Y	-1	-	
2*4Y	-1	-2	-1	-2	5Y	-1	-1	
2*5Y	2	-2	2	-3				
3*4Y	1	-2	1	-1				
3*5Y	4	-2	4	-2				
4*5Y	3	-	3	-1				
5*7Y	5	-1	5	-1				
5*10Y	15	-1	16	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	3.07	3.01	2.97	2.92	2.91	2.91	2.91
今日	3.10	3.08	3	3.08	2.95	2.94	2.94

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-8	28	-2	34
今日	-8	26	-1	35



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”) 仅提供供参考, 且为保密的利/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国联证券经纪有限公司 (以下简称“上海国联证券”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资策略或任何交易策略相关的推介、定价、建议或诱导。“信息”不可作为投资决策, 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