



【2024-12-02】

中国央行今日进行 333 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平。今日有 2493 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2465 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.73%，与上一交易日下降 7bp，3m shibor fixing: 1.8250%，与上一交易日下降 2.7bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.6075%附近，后震荡下行，成交在 1.5825%-1.6075%区间附近，午盘报收 59/58.5。中午回来，5y repo 继续震荡成交在 1.575%-1.59%区间附近，报收 58.25/58。1y repo 全天震荡成交在 1.53%-1.55%区间附近，报收 53.5/53。其他期限，3m repo 成交在 1.7025%附近，6m repo 成交在 1.5975%-1.6325%区间附近，9m repo 成交在 1.57%附近，2y repo 成交在 1.49%-1.495%区间附近，4y repo 成交在 1.5375%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在-08.75bp 点位，6mx9m repo 成交在-04bp 点位，6mx1y repo 成交在-08~-08.5bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-03.5bp 点位，1x2y repo 成交在-04~-04.25bp 区间附近，4x5y repo 成交在 04.25bp 点位，2x5y repo 成交在 09-09.25bp 区间附近，1x5y repo 成交在 05-06bp 区间附近，报收 5/4.5。

Shibor 端今日成交清淡， 1y shibor 成交在 1.5725%附近，报收 57.75/56.25，5y shibor 报收 61.5/60。曲线方面，1x5y shibor 报收 5/3.5。基差方面，1y basis 成交在 04bp 点位，报收 4.5/3.5，5y basis 报收 3.75/2.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

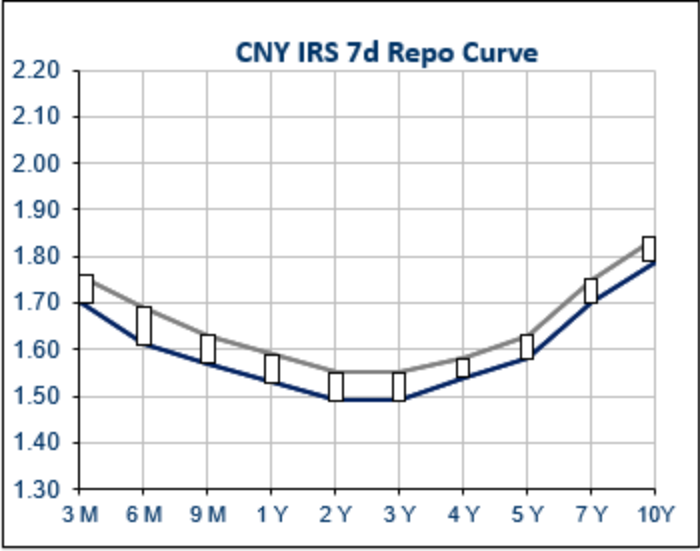
2024/12/2 星期一

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
3 M	1. 7	-6				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 61	-8	6 M	1. 69	-7	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 57	-6	9 M	1. 62	-6	9 M	1. 6	-						
1 Y	1. 53	-6	1 Y	1. 57	-6	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 52	-6
2 Y	1. 49	-6	2 Y	1. 53	-5	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 46	-6
3 Y	1. 49	-6	3 Y	1. 54	-5	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 46	-6
4 Y	1. 54	-4	4 Y	1. 57	-5				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 52	-6
5 Y	1. 58	-5	5 Y	1. 61	-6				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 53	-6
7 Y	1. 7	-5	7 Y	1. 74	-6				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 79	-5	10Y	1. 83	-6				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.73	-7.00	3M Shibor	1. 825	-2.70	O-N Shibor	1.414	9.50	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-9	-2			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-4	2	-7	1				
9M*1Y	-4	-	-5	-	6M	8	1	
1*2Y	-4	-	-4	1	9M	5	-	
1*3Y	-4	-	-3	1	1Y	4	-	
1*4Y	1	2	0	1	2Y	4	1	
1*5Y	5	1	4	-	3Y	5	1	
2*3Y	0	-	1	-	4Y	3	-1	
2*4Y	5	2	4	-	5Y	3	-1	
2*5Y	9	1	8	-1				
3*4Y	5	2	3	-				
3*5Y	9	1	7	-1				
4*5Y	4	-1	4	-1				
5*7Y	12	-	13	-				
5*10Y	21	-	22	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	8	5	4	2	2	2	3
今日	8	5	4	2	2	2	3

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	39	10	49
今日	-1	40	11	49



。

联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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。其知识仅限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、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、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

文 / Joyce Zhang