

常规报告系列

收盘日评 银行间利率衍生品市场



【2024-11-26】

中国央行今日进行 2993 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 2883 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 110 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.83%，与上一交易日下降 7bp，3m shibor fixing: 1.860%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.655%附近，后震荡成交在 1.67%-1.655%区间附近，午盘报收 66/65.75。中午回来，5y repo 继续震荡成交在 1.6675%-1.65%区间附近，报收 66.25/66。1y repo 全天震荡成交在 1.6275%-1.64%区间附近，报收 63.25/63。其他期限，3m repo 成交在 1.815%附近，6m repo 成交在 1.74%附近，9m repo 成交在 1.6775%附近，2y repo 成交在 1.575%区间附近,3y repo 成交在 1.5725%附近。曲线方面，6mx1y repo 成交在-10.75bp 点位，9mx1y repo 成交在-04.75~-04.5bp 区间附近，3x5y repo 成交在 08bp 点位，1x5y repo 成交在 2.5-2.75bp 区间附近，报收 3/2.75。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.6675%附近，报收 67/66.5，2y shibor 成交在 1.61%附近，5y shibor 报收 70/69.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 3.5/3。基差方面，1y basis 报收 3.75/3.25，5y basis 报收 4 /3.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

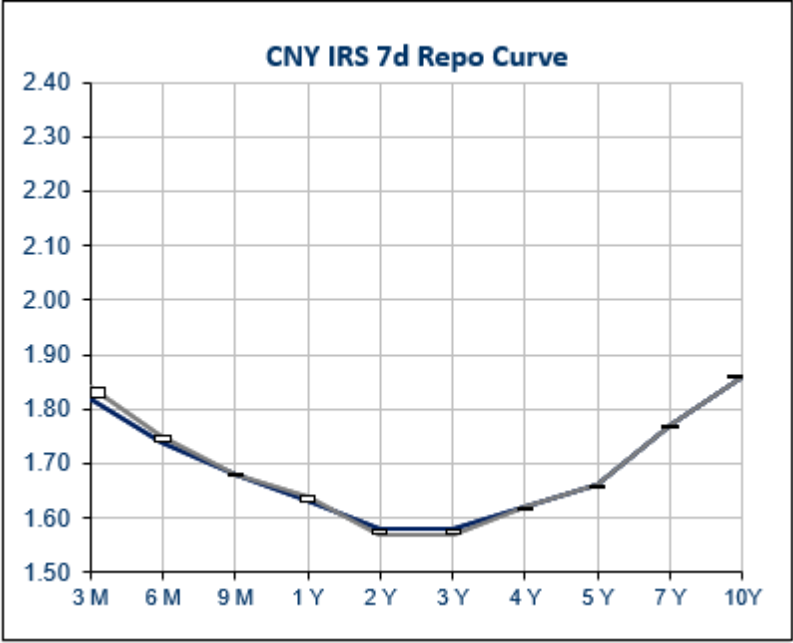
2024/11/26 星期二

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	1.82	-2				3 M	1.6	-						
6 M	1.74	-1	6 M	1.8	1	6 M	1.6	-						
9 M	1.68	-	9 M	1.72	-	9 M	1.6	-						
1 Y	1.63	-1	1 Y	1.67	-	1 Y	1.5	-				1Y	1.63	-
2 Y	1.58	1	2 Y	1.62	1	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.56	-
3 Y	1.58	1	3 Y	1.61	-	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.55	-
4 Y	1.62	-	4 Y	1.65	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.61	-1
5 Y	1.66	-	5 Y	1.7	1				5 Y	1.8	-	5Y	1.61	-1
7 Y	1.77	-	7 Y	1.82	-				7 Y	1.8	-			
10Y	1.86	-	10Y	1.91	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.83	-7.00	3M Shibor	1.86	-	O-N Shibor	1.43	-3.40	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-8	1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	1	-8	-1				
9M*1Y	-5	-1	-5	-	6M	6	2	
1*2Y	-5	2	-5	1	9M	4	-	
1*3Y	-5	2	-6	-	1Y	4	1	
1*4Y	-1	1	-2	-	2Y	4	-	
1*5Y	3	1	3	1	3Y	3	-1	
2*3Y	0	-	-1	-1	4Y	3	-	
2*4Y	4	-1	3	-1	5Y	4	1	
2*5Y	8	-1	8	-				
3*4Y	4	-1	4	-				
3*5Y	8	-1	9	1				
4*5Y	4	-	5	1				
5*7Y	11	-	12	-1				
5*10Y	20	-	21	-1				

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	40	14	51
今日	-2	40	14	51



。

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:
以上所发及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或者有别的意图, 其知识仅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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息