



【2024-12-26】

央行今日进行 1063 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平。因今日有 806 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 257 亿元。资金面整体均衡，下午均衡偏松。7d repo fixing: 2.24%，与上一交易日上涨 19bp，3m shibor fixing: 1.6922%，与上一交易日下降 0.08bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.4525%附近，上午震荡成交在 1.4425%-1.4575%区间附近，午盘报收 46/45.75。中午回来，5y repo 上行成交到 1.4625%附近，后震荡成交在 1.4675%-1.4525%区间附近，报收 45/44.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.4475%-1.465%区间附近，报收 45.25/45。其他期限，6m repo 成交在 1.5525%附近，9m repo 成交在 1.4925%附近，2y repo 成交在 1.4025%附近，3y repo 成交在 1.395%附近。曲线方面，9mx3y repo 成交在-9.75bp 点位，6mx5y repo 成交在-9.5 至-10bp 区间附近，6mx1y repo 成交在-10bp 点位，9mx1y repo 成交在-3.75 至-4bp 区间附近，2x3y repo 成交在-0.75bp 点位，1x5y repo 成交在-0.25 至 00bp 区间附近，报收 0/-0.5。

Shibor 端，1y shibor 报收 44.5/43，5y shibor 成交在 1.445%-1.4525%区间附近，报收 44.75/44.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 1.25/-0.25。基差方面，1y basis 报收-0.75/-2，5y basis 报收-0.25/-0.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

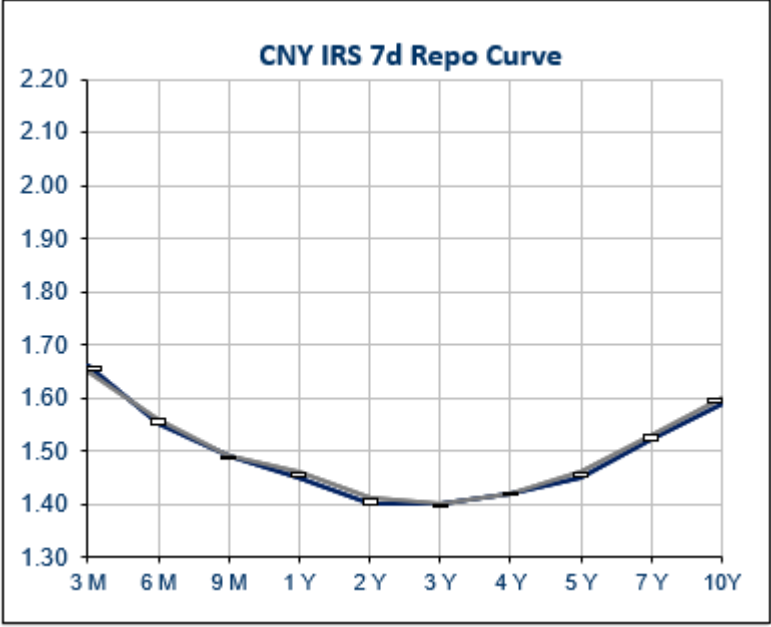
2024/12/26 星期四

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	1.66	1				3 M	1.5	-						
6 M	1.55	-1	6 M	1.56	-2	6 M	1.5	-						
9 M	1.49	-	9 M	1.49	-1	9 M	1.5	-						
1 Y	1.45	-1	1 Y	1.44	-1	1 Y	1.4	-				1Y	1.44	-1
2 Y	1.4	-1	2 Y	1.39	-	2 Y	1.4	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.37	-1
3 Y	1.4	-	3 Y	1.39	-	3 Y	1.5	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.36	-1
4 Y	1.42	-	4 Y	1.41	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.39	-1
5 Y	1.45	-1	5 Y	1.44	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.41	-1
7 Y	1.52	-1	7 Y	1.52	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	1.59	-1	10Y	1.62	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.24	19.00	3M Shibor	1.6922	-0.08	O-N Shibor	1.386	2.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-11	-2			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	1	-7	1				
9M*1Y	-4	-1	-5	-	6M	1	-1	
1*2Y	-5	-	-5	1	9M	0	-1	
1*3Y	-5	1	-5	1	1Y	-1	-	
1*4Y	-3	1	-3	1	2Y	-1	1	
1*5Y	0	-	0	-	3Y	-1	-	
2*3Y	0	1	0	-	4Y	-1	-	
2*4Y	2	1	2	-	5Y	-1	-	
2*5Y	5	-	5	-1				
3*4Y	2	-	2	-				
3*5Y	5	-1	5	-1				
4*5Y	3	-1	3	-1				
5*7Y	7	-	8	-				
5*10Y	14	-	18	-				

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	3.07	3.01	2.97	2.92	2.91	2.91	2.91

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-8	31	1	38
今日	-9	29	-1	37



。

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”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或者有用的信息, 其知识仅属于上海国际货币经纪有限责任公司 (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、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、及时性或准确性等需求, 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