



【2024-12-13】

 中国人民银行公开市场今日开展 2051 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率持平 1.50%。今日有 1909 亿元逆回购到期。资金面整体偏紧。7d repo fixing：1.93%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.7350%，与上一交易日下降 0.5bp。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.47%附近，后震荡成交在 1.465%-1.495%区间附近，午盘报收 46.75/46.50。中午回来，5y repo 震荡上行，成交在 1.465%-1.49%区间附近，报收 49/48.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.475%-1.435%区间附近，报收 47.5/47.25。其他期限，1m repo 成交在 1.86%附近，3m repo 成交在 1.6825%-1.7175%区间附近，6m repo 成交在 1.56%-1.5875%区间附近，9m repo 成交在 1.505%附近，3y repo 成交在 1.3875%-1.41%区间附近。曲线方面，3mx1y repo 成交在-24--26bp 区间附近，6mx9m repo 成交在-7bp 附近，6mx1y repo 成交在-11.25--12.25bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-5bp 附近，1x5y repo 成交在 3.75-1.75bp 附近，曲线走平，报收 1.75/1.25。

 Shibor 端，1y shibor 报收 49.5/47.75，5y shibor 报收 51.5/49.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 2.75/0。基差方面，1y basis 报收 2/0.5，5y basis 报收 2.5/0.75。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

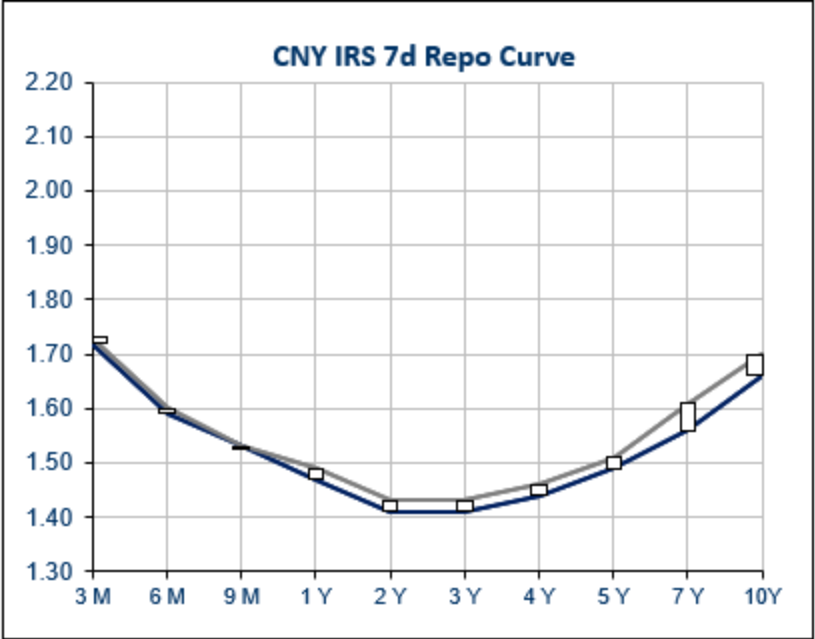
2024/12/13 星期五

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. 72	-1				3 M	1. 48	-12									
6 M	1. 59	-1	6 M	1. 62	-1	6 M	1. 48	-12									
9 M	1. 53	-	9 M	1. 54	-	9 M	1. 48	-12									
1 Y	1. 47	-2	1 Y	1. 49	-1	1 Y	1. 48	-2							1Y	1. 47	-1
2 Y	1. 41	-2	2 Y	1. 44	-1	2 Y	1. 46	-4	2 Y	1. 65	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 39	-3
3 Y	1. 41	-2	3 Y	1. 44	-1	3 Y	1. 56	-4	3 Y	1. 77	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 38	-3
4 Y	1. 44	-2	4 Y	1. 47	-1				4 Y	1. 8	-	4 Y	1. 8	-	4Y	1. 44	-3
5 Y	1. 49	-2	5 Y	1. 51	-1				5 Y	1. 8	-	5 Y	1. 8	-	5Y	1. 45	-3
7 Y	1. 56	-5	7 Y	1. 59	-4				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 66	-4	10Y	1. 69	-3				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.93	-2.00	3M Shibor	1. 735	-0.50	O-N Shibor	1.404	-7.80	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-13	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	1	-8	1				
9M*1Y	-6	-2	-5	-1	6M	3	-	
1*2Y	-6	-	-5	-	9M	1	-	
1*3Y	-6	-	-5	-	1Y	2	1	
1*4Y	-3	-	-2	-	2Y	3	1	
1*5Y	2	-	2	-	3Y	3	1	
2*3Y	0	-	0	-	4Y	3	1	
2*4Y	3	-	3	-	5Y	2	1	
2*5Y	8	-	7	-				
3*4Y	3	-	3	-				
3*5Y	8	-	7	-				
4*5Y	5	-	4	-				
5*7Y	7	-3	8	-3				
5*10Y	17	-2	18	-2				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	3.07	3.02	2.98	2.93	2.92	2.92	2.92
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	-5	31	5	39
今日	-10	29	3	38



。

联系人: Ruby Wu
邮箱: xiating.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:
以上所述及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅得以提供信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识产权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报价、定价、建议或建议。“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