



【2024-11-27】

中国央行今日进行 2683 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 3021 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 338 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.80%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 1.8590%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.66%，震荡成交在 1.66%-1.6475%区间附近，午盘报收 66/65.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.6725%-1.6525%区间附近，报收 67.5/67。1y repo 全天震荡成交在 1.6425%-1.625%区间附近，报收 64.5/64。其他期限，3m repo 成交在 1.82%-1.825%区间附近，6m repo 成交在 1.7375%-1.745%区间附近，9m repo 成交在 1.6725%-1.685%区间附近，2y repo 成交在 1.5775%-1.59%区间附近，3y repo 成交在 1.575%-1.5775%区间附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在-08bp 到-08.25bp 区间附近，6mx9m repo 成交在-6.5bp 点位，3mx9m repo 成交在-14.75bp 点位，6mx1y repo 成交在-11bp 到-11.25bp 区间附近，9mx1y repo 成交在-4.5bp 点位，1x2y repo 成交在-05.25bp 附近，2x3y repo 成交在 0 到-0.25bp 区间附近，2x5y repo 成交在 08bp 点位，3x5y repo 成交在 08bp 点位，1x5y repo 成交在 2.5-3bp 区间附近，报收 3.25/2.75。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.67%附近，报收 68/67，5y shibor 报收 70.75/69.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 03.75/02.25。基差方面，1y basis 报收 3.75/2.75，5y basis 报收 3.75/3。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

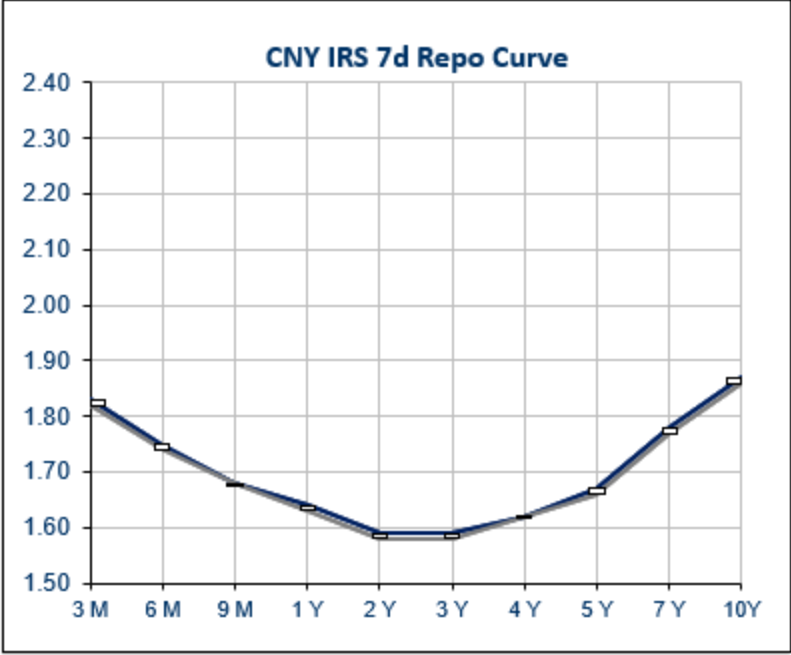
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/11/27 星期三

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. 83	1				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 75	1	6 M	1. 8	-	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 68	-	9 M	1. 73	1	9 M	1. 6	-									
1 Y	1. 64	1	1 Y	1. 68	1	1 Y	1. 5	-							1Y	1. 64	1
2 Y	1. 59	1	2 Y	1. 62	-	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2 Y	1. 57	1	2Y	1. 57	1
3 Y	1. 59	1	3 Y	1. 62	1	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3 Y	1. 56	1	3Y	1. 56	1
4 Y	1. 62	-	4 Y	1. 66	1				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 63	2	4Y	1. 63	2
5 Y	1. 67	1	5 Y	1. 7	-				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 64	3	5Y	1. 64	3
7 Y	1. 78	1	7 Y	1. 83	1				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 87	1	10Y	1. 92	1				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.80	-3.00	3M Shibor	1. 859	-0.10	O-N Shibor	1.385	-4.50	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-8	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-7	-1	-7	1				
9M*1Y	-4	1	-5	-	6M	5	-1	
1*2Y	-5	-	-6	-1	9M	5	1	
1*3Y	-5	-	-6	-	1Y	4	-	
1*4Y	-2	-1	-2	-	2Y	3	-1	
1*5Y	3	-	2	-1	3Y	3	-	
2*3Y	0	-	0	1	4Y	4	1	
2*4Y	3	-1	4	1	5Y	3	-1	
2*5Y	8	-	8	-				
3*4Y	3	-1	4	-				
3*5Y	8	-	8	-1				
4*5Y	5	1	4	-1				
5*7Y	11	-	13	1				
5*10Y	20	-	22	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	39	13	49



联系人: Ruby Hu
邮箱: ruby.hu@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, 且为保密的利/读者专用的信息。其知识产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”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、股票或任何交易策略相关的报价、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