



【2024-11-29】

中国人民银行公开市场今日开展 4790 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率持平 1.50%。今日有 6351 亿元逆回购到期。公开市场本周净回笼 3820 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.80%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.8520%，与上一交易日下降 0.6bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.64%附近，后稍微震荡下行，成交在 1.64%-1.63%区间附近，又震荡上行，最高成交到 1.6525%附近，午盘报收 65/64.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.645%-1.625%区间附近，报收 63/62.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.615%-1.5825%区间附近，报收 59.5/58.25。其他期限，1m repo 成交在 1.80%附近，3m repo 成交在 1.78%-1.775%附近，6m repo 成交在 1.69%附近，9m repo 成交在 1.6425%-1.6475%附近，2y repo 成交在 1.5575%附近，3y repo 成交在 1.5625%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-4.25bp 附近，6mx1y repo 成交在-10bp 附近，2x3y repo 成交在 0.5bp 附近，1x5y repo 成交在 3-4.5bp 附近，曲线稍微走陡，报收 4.5/3.75。

Shibor 端，6m shibor 成交在 1.755%附近，1y shibor 成交在 1.6225%-1.6275%附近，报收 63/62.5，5y shibor 报收 67.25/65.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 4.75/2.75。基差方面，6m basis 成交在 6.5bp 附近，1y basis 成交在 3.5bp，报收 4.5/3.5，5y basis 报收 4.25/3。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

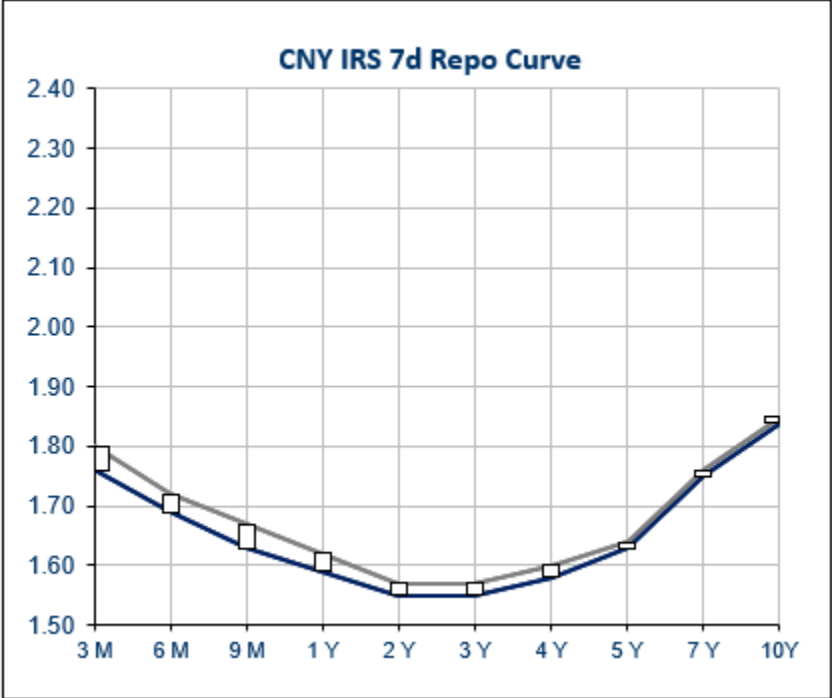
2024/11/29 星期五

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
3 M	1. 76	-4				3 M	1. 6	-						
6 M	1. 69	-3	6 M	1. 76	-2	6 M	1. 6	-						
9 M	1. 63	-4	9 M	1. 68	-3	9 M	1. 6	-						
1 Y	1. 59	-3	1 Y	1. 63	-2	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 58	-3
2 Y	1. 55	-2	2 Y	1. 58	-3	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 52	-2
3 Y	1. 55	-2	3 Y	1. 59	-2	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 52	-1
4 Y	1. 58	-2	4 Y	1. 62	-2				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 58	-2
5 Y	1. 63	-1	5 Y	1. 67	-1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 59	-2
7 Y	1. 75	-1	7 Y	1. 8	-1				7 Y	1. 8	-			
10Y	1. 84	-1	10Y	1. 89	-1				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.80	-2.00	3M Shibor	1. 852	-0.60	O-N Shibor	1.319	-1.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-7	1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	-1	-8	-1				
9M*1Y	-4	1	-5	1	6M	7	1	
1*2Y	-4	1	-5	-1	9M	5	1	
1*3Y	-4	1	-4	-	1Y	4	1	
1*4Y	-1	1	-1	-	2Y	3	-1	
1*5Y	4	2	4	1	3Y	4	-	
2*3Y	0	-	1	1	4Y	4	-	
2*4Y	3	-	4	1	5Y	4	-	
2*5Y	8	1	9	2				
3*4Y	3	-	3	-				
3*5Y	8	1	8	1				
4*5Y	5	1	5	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	-1	40	13	50
今日	-2	39	10	49



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiacang.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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或专有的信息, 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、及时性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang