



【2024-12-30】

中国央行今日开展 891 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 1096 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 205 亿元。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 2.20%，与上一交易日下降 10bp，3m shibor fixing: 1.6850%，与上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.44%附近，后震荡上行成交在 1.435%-1.455%区间附近，午盘报收 45.5/45。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.4525%-1.4625%区间附近，报收 46.25/45.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.445%-1.475%区间附近，报收 47.25/47。其他期限，3m repo 成交在 1.68%附近，6m repo 成交在 1.58%附近，9m repo 成交在 1.51%-1.5125%附近，2y repo 成交在 1.4075%附近，3y repo 成交在 1.395%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-6.75bp 附近，9mx1y repo 成交在-4bp 附近，1x5y repo 成交在-1.25~-1.5bp 附近，报收-1/-1.25。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.44%，报收 45/44，5y shibor 成交在 1.4525%，报收 45.25/44.5。曲线方面，1x5y shibor 成交在 0.5bp，报收 0.5/-0.25。基差方面，1y basis 报收-2.5/-3，5y basis 成交在-0.5bp 附近，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

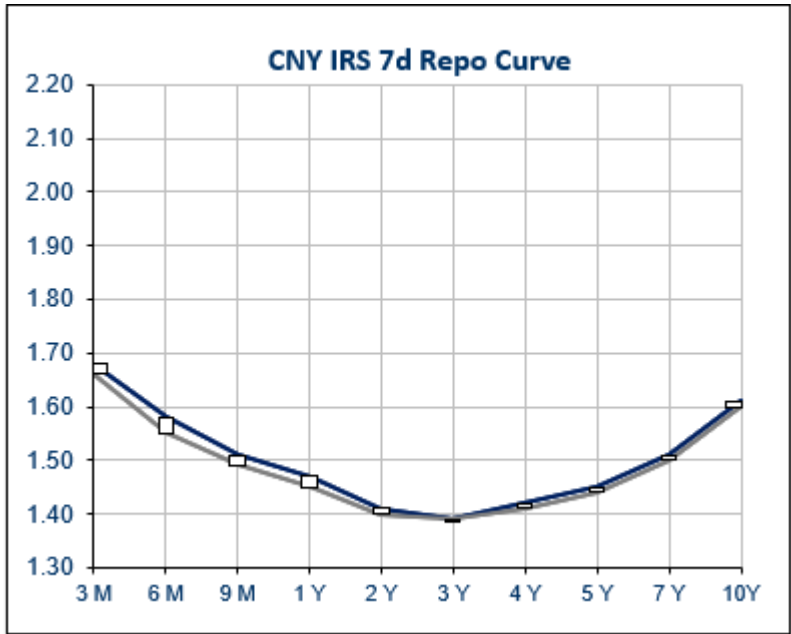
2024/12/30 星期一

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	1.68	2				3 M	1.5	-						
6 M	1.58	3	6 M	1.57	1	6 M	1.5	-						
9 M	1.51	2	9 M	1.49	1	9 M	1.5	-						
1 Y	1.47	2	1 Y	1.44	1	1 Y	1.4	-				1Y	1.47	3
2 Y	1.41	1	2 Y	1.4	1	2 Y	1.4	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.39	2
3 Y	1.39	-	3 Y	1.39	-	3 Y	1.5	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.36	1
4 Y	1.42	1	4 Y	1.41	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.4	2
5 Y	1.45	1	5 Y	1.45	2				5 Y	1.8	-	5Y	1.42	2
7 Y	1.51	1	7 Y	1.51	1				7 Y	1.8	-			
10Y	1.61	1	10Y	1.61	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.20	-10.00	3M Shibor	1.685	-0.50	O-N Shibor	1.367	-2.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-10	1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-7	-1	-8	-				
9M*1Y	-4	-	-5	-	6M	-1	-2	
1*2Y	-6	-1	-4	-	9M	-2	-1	
1*3Y	-8	-2	-5	-1	1Y	-3	-1	
1*4Y	-5	-1	-3	-	2Y	-1	-	
1*5Y	-2	-1	1	1	3Y	0	-	
2*3Y	-2	-1	-1	-1	4Y	-1	-	
2*4Y	1	-	1	-	5Y	0	1	
2*5Y	4	-	5	1				
3*4Y	3	1	2	1				
3*5Y	6	1	6	2				
4*5Y	3	-	4	1				
5*7Y	6	-	6	-1				
5*10Y	16	-	16	-1				

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	-9	28	-3	34
今日	-8	28	-2	34



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:
以上所发及附发的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国联证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国联证券”) 或第三方, “信息”不应被解释为与任何金融工具、投资策略任何交易策略相关的推介、定价、建议或诱导, “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, 且可能随时进行修订, 所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang