



【2024-12-23】

中国央行今日开展 1096 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 7531 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 6435 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.73%，与上一交易日下降 7bp，3m shibor fixing: 1.7050%，与上一交易日下降 0.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.3975%附近，后稍微震荡上行，成交在 1.40%-1.4225%区间附近，午盘报收 41.75/41.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.415%-1.43%区间附近，报收 42.75/42.5。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.3825%-1.43%区间附近，报收 42.75/42.5。其他期限，3m repo 成交在 1.605%-1.62%附近，6m repo 成交在 1.515%附近，9m repo 成交在 1.4575%附近，3y repo 成交在 1.36%附近。曲线方面，3mx1y repo 成家在-19bp 附近，6mx9m repo 成交在-5.75bp 附近，6mx1y repo 成交在-8.75bp 附近，9mx1y repo 成交在-3.25bp 附近，1x5y repo 成交在-0.25~-0.75bp 附近，报收 0/-0.25。

Shibor 端，1y shibor 报收 42.5/41.5，3y shibor 成交在 1.3625%附近，5y shibor 报收 42.5/41.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 0.75/-1。基差方面，1y basis 报收 0/-1，5y basis 报收-0.25/-1。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

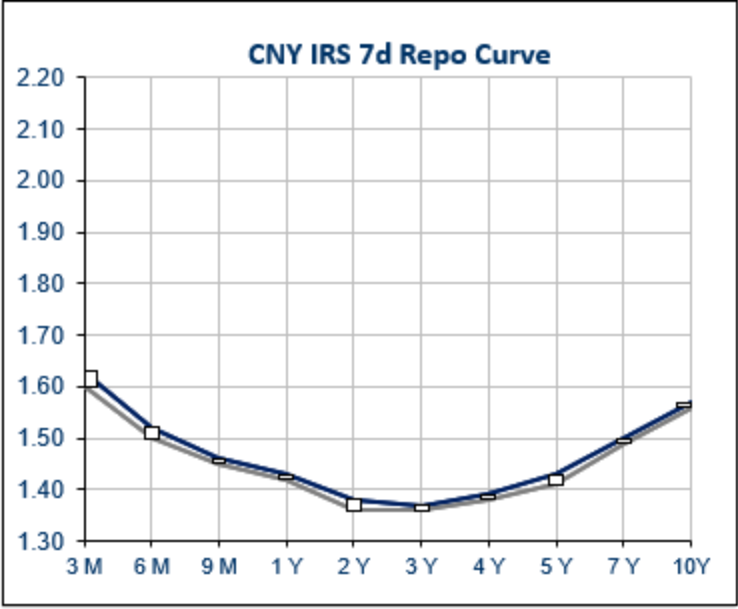
2024/12/23 星期一

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. 63	3				3 M	1. 35	-13									
6 M	1. 52	2	6 M	1. 55	2	6 M	1. 33	13									
9 M	1. 46	1	9 M	1. 48	1	9 M	1. 23	3									
1 Y	1. 43	1	1 Y	1. 42	1	1 Y	1. 23	2				1Y	1. 42	-			
2 Y	1. 38	2	2 Y	1. 37	2	2 Y	1. 49	13	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 35	1			
3 Y	1. 37	1	3 Y	1. 37	1	3 Y	1. 57	1	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 34	1			
4 Y	1. 39	1	4 Y	1. 38	1				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 37	1			
5 Y	1. 43	2	5 Y	1. 42	1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 38	-			
7 Y	1. 5	1	7 Y	1. 51	1				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 57	1	10Y	1. 61	1				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.73	-7.00	3M Shibor	1. 705	-0.30	O-N Shibor	1.31	-10.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-11	-1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	-1	-7	-1				
9M*1Y	-3	-	-6	-	6M	3	-	
1*2Y	-5	1	-5	1	9M	2	-	
1*3Y	-6	-	-5	-	1Y	-1	-	
1*4Y	-4	-	-4	-	2Y	-1	-	
1*5Y	0	1	0	-	3Y	0	-	
2*3Y	-1	-1	0	-1	4Y	-1	-	
2*4Y	1	-1	1	-1	5Y	-1	-1	
2*5Y	5	-	5	-1				
3*4Y	2	-	1	-				
3*5Y	6	1	5	-				
4*5Y	4	1	4	-				
5*7Y	7	-1	9	-				
5*10Y	14	-1	19	-				

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	3	38
今日	-10	29	0	36



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:

以上所述及附带的任何信息 (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脉货币经纪有限公司 (以下简称“上海国脉货币”) 或其三方。“信息”不应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、建议或推荐。“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。且可未经通知地进行修改, 所有前述和保证均按初始免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang