



【2024-11-14】

中国央行今日进行 3282 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 192 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 3090 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.89%，与上一交易日下降 1bp，3m shibor fixing: 1.8580%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.7075%附近，后小幅震荡成交在 1.70%-1.7075%区间附近，午盘报收 70.5/70。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 1.70%-1.6825%区间附近，报收 68.5/68.25。1y repo 全天震荡成交在 1.6575%-1.6475%区间附近，报收 65.25/65。其他期限，9m repo 成交在 1.7025%附近，2y repo 成交在 1.5875%-1.59%区间附近，4y repo 成交在 1.6425%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在 -4.5~-5bp 区间附近，1x2y repo 成交在 -6.25~-6.5bp 区间附近，2x4y repo 成交在 5bp 点位，1x5y repo 成交在 3.5-4.25bp 区间附近，曲线走平，报收 3.5/3。

Shibor 端今日成交清淡，6m shibor 成交在 1.795%附近，1y shibor 成交在 1.6725%-1.675%区间附近，报收 67.25/66.5，5y shibor 报收 74/72.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 7/5.25。基差方面，1y basis 成交在 02bp 点位，报收 2.25/1.5，5y basis 报收 5.5/4。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

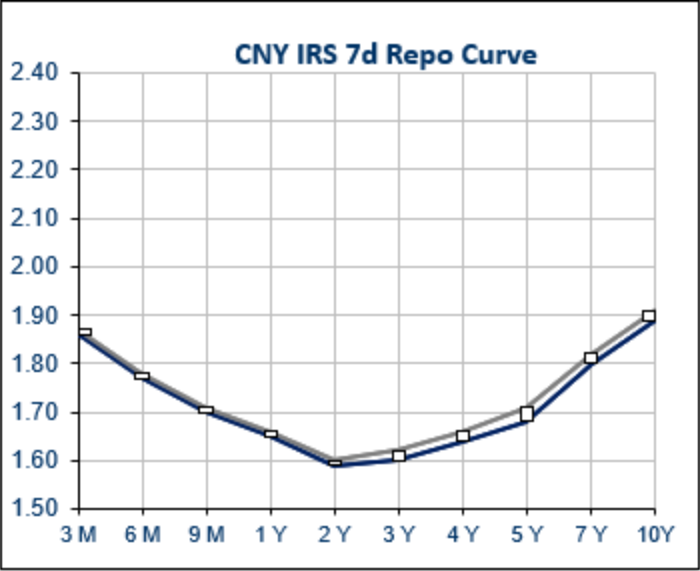
2024/11/14 星期四

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	1.86	-1				3 M	1.6	-									
6 M	1.77	-1	6 M	1.8	-	6 M	1.6	-									
9 M	1.7	-1	9 M	1.73	-	9 M	1.6	-									
1 Y	1.65	-1	1 Y	1.67	-1	1 Y	1.5	-				1Y	1.65	-1			
2 Y	1.59	-1	2 Y	1.62	-1	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.57	-2			
3 Y	1.6	-2	3 Y	1.63	-2	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.58	-1			
4 Y	1.64	-2	4 Y	1.68	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.64	-2			
5 Y	1.68	-3	5 Y	1.73	-2				5 Y	1.8	-	5Y	1.65	-2			
7 Y	1.8	-2	7 Y	1.85	-2				7 Y	1.8	-						
10Y	1.89	-2	10Y	1.94	-2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.89	-1.00	3M Shibor	1.858	-0.10	O-N Shibor	1.456	-0.90	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
					Tenor	Mid	Δbp	
3M*6M	-9	-						
6M*9M	-7	-	-7	-				
9M*1Y	-5	-	-6	-1	6M	3	1	
1*2Y	-6	-	-5	-	9M	3	1	
1*3Y	-5	-1	-4	-1	1Y	2	-	
1*4Y	-1	-1	1	-1	2Y	3	-	
1*5Y	3	-2	6	-1	3Y	3	-	
2*3Y	1	-1	1	-1	4Y	4	-	
2*4Y	5	-1	6	-1	5Y	5	1	
2*5Y	9	-2	11	-1				
3*4Y	4	-	5	-				
3*5Y	8	-1	10	-				
4*5Y	4	-1	5	-				
5*7Y	12	1	12	-				
5*10Y	21	1	21	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	12	9	7	4	3	4	6
今日	12	9	7	4	3	4	6

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	40	11	49
今日	0	42	14	52



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、或者专用的信息。其知识产属于上海国际市场经纪有限公司 (以下简称“上海国际”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为任何金融工具、投资建议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