



【2024-12-19】

中国央行今日开展 806 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 661 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 145 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.84%，与上一交易日下降 9bp，3m shibor fixing: 1.7120%，与上一交易日下降 0.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.4875%附近，震荡上行，成交在 1.48%-1.5050%区间附近，午盘报收 50.75/50.25。中午回来，5y repo 成交在 1.50%附近，后持续震荡下行，成交在 1.4675%-1.50%区间附近，尾盘略微回升后稳定在 1.4725%，报收 47.50/47.25。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.4675%-1.4975%区间附近，报收 47/46.75。其他期限，3m repo 成交在 1.725%-1.7325%附近，6m repo 成交在 1.59%-1.595% 附近，9m repo 成交在 1.5275%-1.53%附近，2y repo 成交在 1.4225%-1.4325%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在-14bp 附近，6mx9m repo 成交在-06.75 至-06.5bp 附近，6mx1y repo 成交在-11 至-10.5bp 附近，9mx1y repo 成交在-04.25 至-4bp 附近，1x2y repo 成交在-06 至-05.75bp 附近，2x5y repo 成交在 05.75 至 06.25bp 附近，1x5y repo 成交 0 至 0.5bp 附近，报收 1.0/00。

Shibor 端，1y shibor 报收 47/45.75，5y shibor 报收 47/45.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 1.25/-1.25。基差方面，1y basis 报收 0/-1.0，5y basis 报收-0.5/-01.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

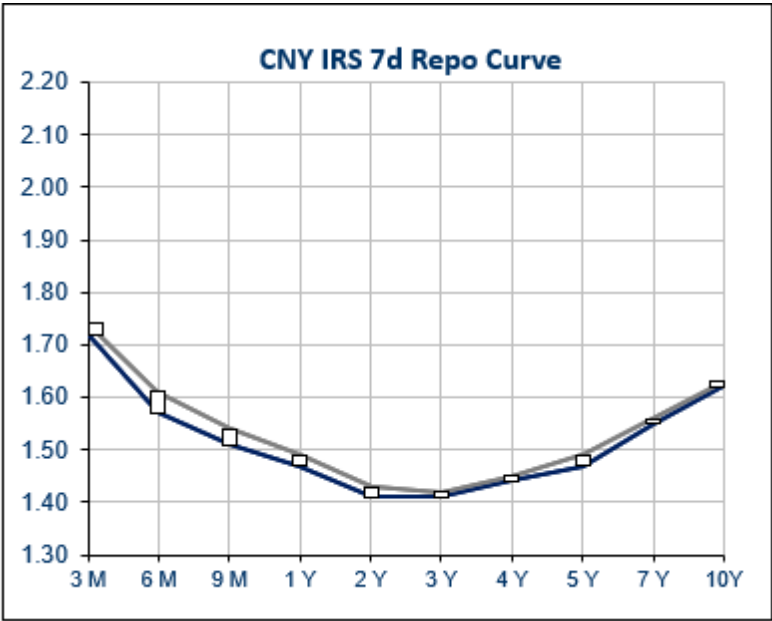
2024/12/19 星期四

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	1.72	-2				3 M	1.5	-									
6 M	1.57	-4	6 M	1.6	-1	6 M	1.51	-									
9 M	1.51	-3	9 M	1.52	-1	9 M	1.51	-									
1 Y	1.47	-2	1 Y	1.46	-2	1 Y	1.51	-				1Y	1.47	-2			
2 Y	1.41	-2	2 Y	1.4	-1	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.39	-2			
3 Y	1.41	-1	3 Y	1.41	1	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.38	-2			
4 Y	1.44	-1	4 Y	1.42	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.41	-2			
5 Y	1.47	-2	5 Y	1.46	-3				5 Y	1.8	-	5Y	1.43	-3			
7 Y	1.55	-1	7 Y	1.55	-2				7 Y	1.8	-						
10Y	1.62	-1	10Y	1.65	-2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.84	-9.00	3M Shibor	1.712	-0.30	O-N Shibor	1.424	-0.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-15	-2		Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	1	-8 -				
9M*1Y	-4	1	-6 -1	6M	3	3	
1*2Y	-6	-	-6 1	9M	1	2	
1*3Y	-6	1	-5 3	1Y	-1	-	
1*4Y	-3	1	-4 -	2Y	-1	1	
1*5Y	0	-	0 -1	3Y	0	2	
2*3Y	0	1	1 2	4Y	-2	-1	
2*4Y	3	1	2 -1	5Y	-1	-1	
2*5Y	6	-	6 -2				
3*4Y	3	-	1 -3				
3*5Y	6	-1	5 -4				
4*5Y	3	-1	4 -1				
5*7Y	8	1	9 1				
5*10Y	15	1	19 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	35
今日	-10	29	2	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。其知识产仅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任何投资建议。投资者在任何交易决策相关的报价、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