



【2024-12-17】

中国央行今日开展 3554 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 1416 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 2138 亿元。资金面整体偏紧。7d repo fixing: 2.05%，与上一交易日上升 10bp，3m shibor fixing: 1.7180%，与上一交易日下降 0.7bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.50%附近，后震荡下行，成交在 1.50%-1.49%区间附近，午盘报收 49.5/49.25。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 1.50%-1.4825%区间附近，尾盘报收 48/47.75。1y repo 全天震荡成交在 1.51%-1.50%区间附近，报收 50.5/50。其他期限，3m repo 成交在 1.7575%附近，6m repo 成交在 1.625%-1.6275%区间附近，9m repo 成交在 1.555%附近，2y repo 成交在 1.43%附近，3y repo 成交在 1.42%-1.4225%附近，4y repo 成交在 1.4425%-1.4475%区间附近。曲线方面，6mx1y repo 成交在 -12.25bp 附近，9mx1y repo 成交在 -5bp 附近，3x4y repo 成交在 02bp 附近，4x5y 成交在 04.5bp-04.75bp 附近，1x5y repo 成交在 -1bp 到 -1.75bp 区间附近，报收 -1.75/-2。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.48%-1.4875%区间附近，报收 48/47，5y shibor 报收 48.75/47。曲线方面，1x5y shibor 报收 1.75/0。基差方面，1y basis 成交在 -2bp 到 -2.5bp 区间附近，报收 -2/-2.75，5y basis 报收 0.5/-1。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

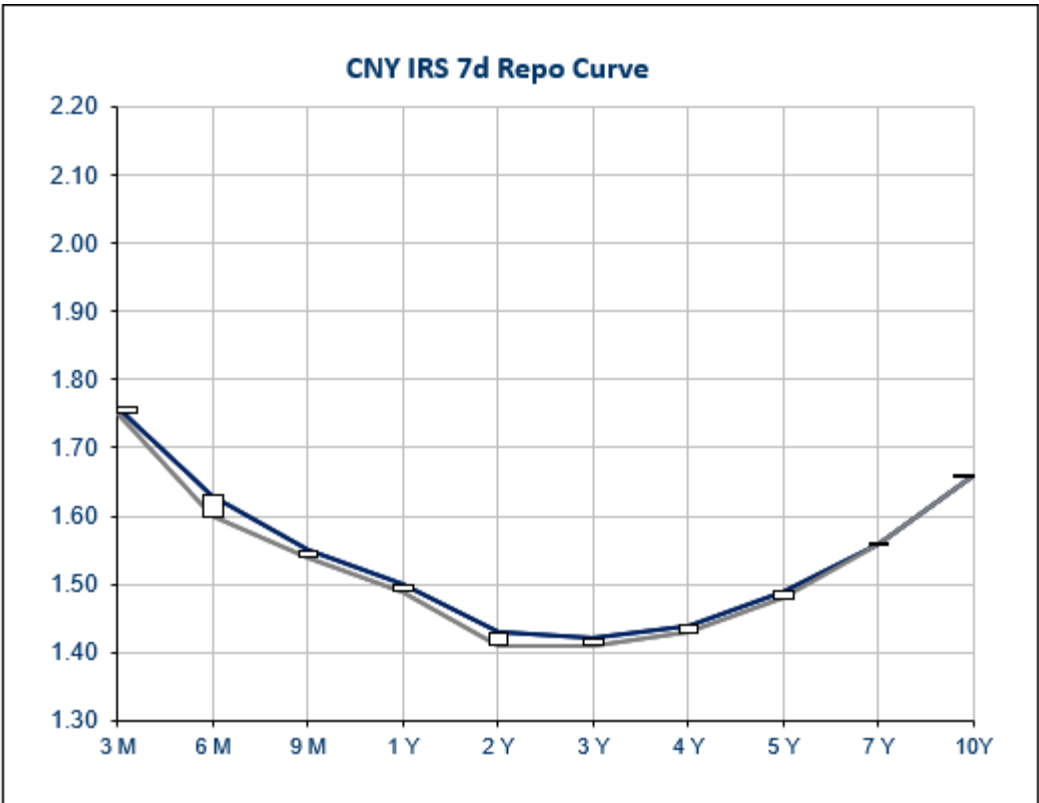
2024/12/17 星期二

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	1				3 M	1.48	-						
6 M	1.63	3	6 M	1.63	2	6 M	1.48	-						
9 M	1.55	1	9 M	1.54	1	9 M	1.48	-						
1 Y	1.5	1	1 Y	1.48	1	1 Y	1.48	-				1Y	1.49	1
2 Y	1.43	2	2 Y	1.4	-	2 Y	1.46	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.4	1
3 Y	1.42	1	3 Y	1.42	1	3 Y	1.56	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.4	2
4 Y	1.44	1	4 Y	1.44	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.42	-
5 Y	1.49	1	5 Y	1.48	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.44	-
7 Y	1.56	-	7 Y	1.59	-				7 Y	1.8	-			
10Y	1.66	-	10Y	1.69	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.05	10.00	3M Shibor	1.718	-0.70	O-N Shibor	1.404	-	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-13	2			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-8	-2	-9	-1				
9M*1Y	-5	-	-6	-	6M	0	-1	
1*2Y	-7	1	-8	-1	9M	-1	-	
1*3Y	-8	-	-6	-	1Y	-2	-	
1*4Y	-6	-	-4	-	2Y	-3	-2	
1*5Y	-1	-	0	-1	3Y	0	-	
2*3Y	-1	-1	2	1	4Y	0	-	
2*4Y	1	-1	4	1	5Y	-1	-1	
2*5Y	6	-1	8	-				
3*4Y	2	-	2	-				
3*5Y	7	-	6	-1				
4*5Y	5	-	4	-1				
5*7Y	7	-1	11	-				
5*10Y	17	-1	21	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	3.07	3.01	2.95	2.92	2.91	2.90	2.90
今日	3.07	3.01	2.95	2.91	2.91	2.91	2.91

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-12	25	2	34
今日	-10	26	3	35



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:
以上所述及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅得以提供信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识“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”) 或其三方。”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, 所有前述和保证均被明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang