



【2024-11-15】

中国央行今日进行 9810 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 122 亿元 7 天期逆回购到期和 14500 亿元 1 年期 MLF 到期，当日实现净回笼 4812 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing：1.85%，与上一交易日下降 4bp，3m shibor fixing: 1.8560%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.685%附近，后小幅震荡成交在 1.6875%-1.6775%区间附近，午盘报收 68.75/68.25。中午回来，5y repo 震荡上行，成交在 1.6975%-1.6775%区间附近，报收 70/69.5。1y repo 全天震荡成交在 1.6425%-1.6575%区间附近，报收 66/65.5。其他期限，1m repo 成交在 1.87%附近，9m repo 成交在 1.695%附近，2y repo 成交在 1.5875%-1.595%区间附近，3y repo 成交在 1.5925%-1.60%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-5bp 附近，3x5y repo 成交在 08.5bp 附近，2x5y repo 成交在 09-09.25bp 区间附近，1x5y repo 成交在 3.75-4bp 区间附近，报收 4.25/3.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 成交在 1.675%附近，报收 67.75/67.25，5y shibor 成交在 1.73%附近，报收 74.25/73.25。曲线方面，1x5y shibor 成交在 05.5bp，报收 06.5/05.5。基差方面，1y basis 报收 2.25/1.75，5y basis 报收 4.25/3.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

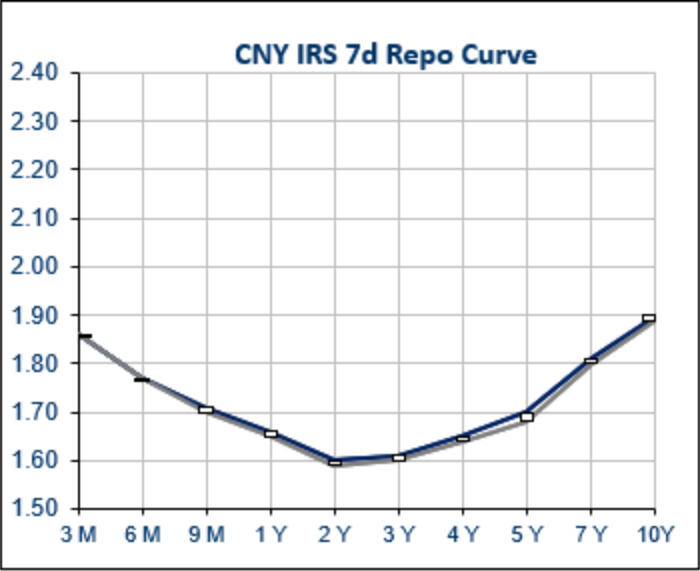
2024/11/15 星期五

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. 86	-				3 M	1. 6	-									
6 M	1. 77	-	6 M	1. 8	-	6 M	1. 6	-									
9 M	1. 71	1	9 M	1. 72	-1	9 M	1. 6	-									
1 Y	1. 66	1	1 Y	1. 68	1	1 Y	1. 5	-				1Y	1. 65	-			
2 Y	1. 6	1	2 Y	1. 63	1	2 Y	1. 5	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 58	1			
3 Y	1. 61	1	3 Y	1. 63	-	3 Y	1. 6	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 59	1			
4 Y	1. 65	1	4 Y	1. 69	1				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 65	1			
5 Y	1. 7	2	5 Y	1. 74	1				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 66	1			
7 Y	1. 81	1	7 Y	1. 86	1				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 9	1	10Y	1. 95	1				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.85	-4.00	3M Shibor	1. 856	-0.20	O-N Shibor	1.47	1.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-9	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-6	1	-8	-1				
9M*1Y	-5	-	-4	2	6M	3	-	
1*2Y	-6	-	-5	-	9M	1	-2	
1*3Y	-5	-	-5	-1	1Y	2	-	
1*4Y	-1	-	1	-	2Y	3	-	
1*5Y	4	1	6	-	3Y	2	-1	
2*3Y	1	-	0	-1	4Y	4	-	
2*4Y	5	-	6	-	5Y	4	-1	
2*5Y	10	1	11	-				
3*4Y	4	-	6	1				
3*5Y	9	1	11	1				
4*5Y	5	1	5	-				
5*7Y	11	-1	12	-				
5*10Y	20	-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	0	42	14	52
今日	-3	41	11	50



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, 且为保密的利/或者专用的信息, 其知识产仅属于上海国际货币经纪有限公司 (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与任何金融工具、股票或任何交易策略相关的报价、定价、建议或建议。“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