

收盘日评
银行间利率衍生品市场

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-11-11】

中国央行：今日进行 1337 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平。今日有 173 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 1164 亿元。资金面整体偏紧。7d repo fixing: 1.88%，与上一交易日上升 8bp，3m shibor fixing: 1.8620%，较上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.7175%附近，后震荡成交在 1.7225%-1.71%区间附近，午盘报收 71.75/71.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.72%-1.7125%区间附近，报收 71.5/71。1y repo 全天震荡成交在 1.65%-1.6675%区间附近，报收 66/65.5。其他期限，1m repo 成交在 1.85%点位附近，3m repo 成交在 1.86%点位附近，6m repo 成交在 1.7675%附近，9m repo 成交在 1.705%点位，2y repo 成交在 1.61%-1.6075%区间附近，4y repo 成交在 1.6625%点位附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-6.25bp 点位，6mx1y repo 成交在-10.5bp 到-10.25bp 点位，2x5y repo 成交在 10.25bp 区间附近，1x2y repo 成交在-5bp 到-5.25bp 区间附近，1x5y repo 成交在 06bp-5.25bp 区间附近，报收 05.75/05.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 1.68%附近，报收 68.25/68，5y shibor 成交在 1.7475%-1.75%区间附近，报收 75.75/75.5。其他期限，6m shibor 成交在 1.80%点位附近，2y shibor 成交在 1.635%附近。曲线方面，1x2shibor 成交在-4.5bp 附近，1x5y shibor 成交在 06.75bp-07bp 区间附近，报收 07.5/07.25。基差方面，1y basis 成交在 01.75bp，报收 2.25/1.75，2y basis 成交在 02.5bp，报收 03/02.5，5y basis 成交在 03.5bp-03.75bp 区间附近，报收 04/03.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2024/11/11 星期一

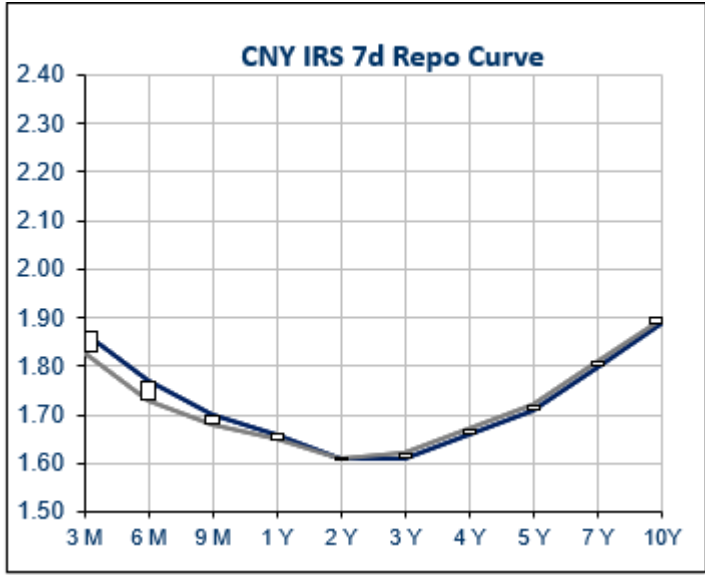
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd											
ONSHORE IRS											
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)		
Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1.87	4				3 M	1.6	-			
6 M	1.77	4	6 M	1.81	-	6 M	1.6	-			
9 M	1.7	2	9 M	1.74	1	9 M	1.6	-			
1 Y	1.66	1	1 Y	1.68	1	1 Y	1.5	-			
2 Y	1.61	-	2 Y	1.63	-	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-
3 Y	1.61	-1	3 Y	1.64	-1	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-
4 Y	1.66	-1	4 Y	1.69	-1				4 Y	1.8	-
5 Y	1.71	-1	5 Y	1.75	-1				5 Y	1.8	-
7 Y	1.8	-1	7 Y	1.85	-1				7 Y	1.8	-
10Y	1.89	-1	10Y	1.94	-1				10Y	1.8	-
7D REPO	1.88	8.00	3M Shibor	1.862	-0.20	O-N Shibor	1.443	-1.80	1Y DEPO	1.50	

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO
3M*6M	-10 -		Tenor	Mid Δbp
6M*9M	-7 -2	-7 1		
9M*1Y	-4 -1	-6 -	6M	4 -4
1*2Y	-5 -1	-5 -1	9M	4 -1
1*3Y	-5 -2	-4 -2	1Y	2 -
1*4Y	0 -2	1 -2	2Y	2 -
1*5Y	5 -2	7 -2	3Y	3 -
2*3Y	0 -1	1 -1	4Y	3 -
2*4Y	5 -1	6 -1	5Y	4 -
2*5Y	10 -1	12 -1		

3*4Y	5	-	5	-		
3*5Y	10	-	11	-		
4*5Y	5	-	6	-		
5*7Y	9	-	10	-		
5*10Y	18	-	19	-		

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	11	9	7	4	4	5	6
今日	12	9	8	4	4	5	7

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	0	40	11	51
今日	0	40	12	50



联系人: Ruby Hu
邮箱: xiaoting.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:
以上所查及列出的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密材料/或者专用的信息, 其知识产权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、投资或任何交易策略相关的推介、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, 所有前述和保证均按前述免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang