



【2024-11-28】

中国央行：今日进行 1903 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 4701 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2798 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.82%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 1.8580%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.665%，震荡下行成交在 1.67%-1.66%区间附近，午盘报收 66.25/66。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.67%-1.64%区间附近，报收 64.5/64。1y repo 全天震荡成交在 1.6425%-1.62%区间附近，报收 62.5/62。其他期限，3m repo 成交在 1.83%-1.825%区间附近，6m repo 成交在 1.75%-1.745%区间附近，9m repo 成交在 1.68%-1.685%区间附近，2y repo 成交在 1.585%-1.57%区间附近，3y repo 成交在 1.585%-1.57%区间附近，4y repo 成交在 1.62%-1.605%附近。7y repo 成交在 1.73%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在-07.75bp 到-08bp 区间附近，3mx9m repo 成交在-14.25bp 点位，9mx1y repo 成交在-4.5bp 点位，1x2y repo 成交在-05.5bp 附近，2x3y repo 成交在 0 bp 区间附近，2x5y repo 成交在 08bp 点位，3x5y repo 成交在 08-07.5bp 点位，3x4y repo 成交在 03.5bp 附近，4x5y repo 成交在 04.5-04.25bp 附近，1x5y repo 成交在 2.5bp 区间附近，报收 02.5/02。

Shibor 端，1y shibor 报收 65.75/65，5y shibor 成交在 1.70%，报收 68.75/68。曲线方面，1x5y shibor 报收 03.75/03。基差方面，1y basis 报收 3.5/3，5y basis 成交 03.5bp，报收 04.25/3.5

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

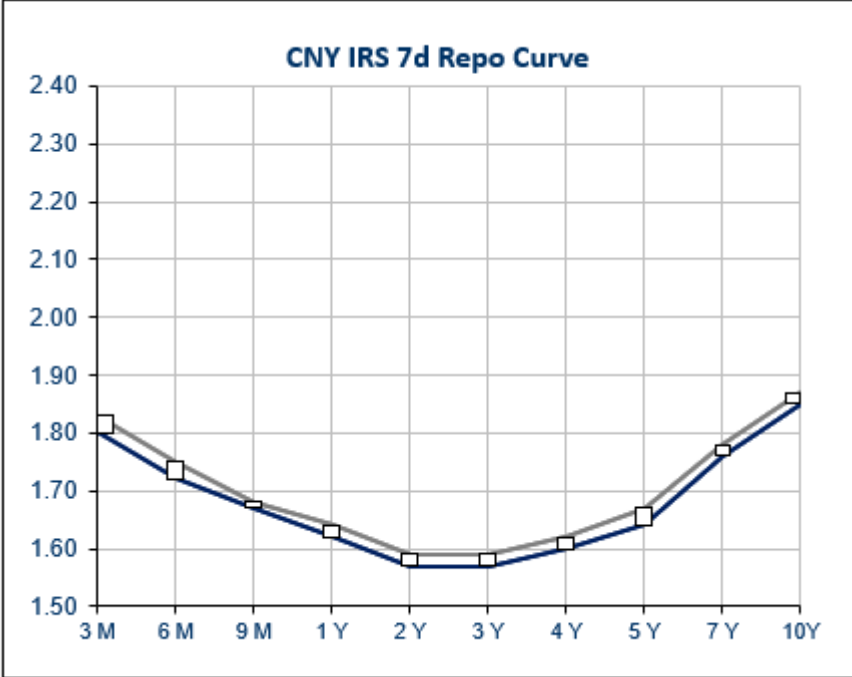
2024/11/28 星期四

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
3 M	1.8	-3				3 M	1.6	-						
6 M	1.72	-3	6 M	1.78	-2	6 M	1.6	-						
9 M	1.67	-1	9 M	1.71	-2	9 M	1.6	-						
1 Y	1.62	-2	1 Y	1.65	-3	1 Y	1.5	-				1Y	1.61	-3
2 Y	1.57	-2	2 Y	1.61	-1	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.54	-3
3 Y	1.57	-2	3 Y	1.61	-1	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.53	-3
4 Y	1.6	-2	4 Y	1.64	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.6	-3
5 Y	1.64	-3	5 Y	1.68	-2				5 Y	1.8	-	5Y	1.61	-3
7 Y	1.76	-2	7 Y	1.81	-2				7 Y	1.8	-			
10Y	1.85	-2	10Y	1.9	-2				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.82	2.00	3M Shibor	1.858	-0.10	O-N Shibor	1.329	-5.60	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-8	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-5	2	-7	-				
9M*1Y	-5	-1	-6	-1	6M	6	1	
1*2Y	-5	-	-4	2	9M	4	-1	
1*3Y	-5	-	-4	2	1Y	3	-1	
1*4Y	-2	-	-1	1	2Y	4	1	
1*5Y	2	-1	3	1	3Y	4	1	
2*3Y	0	-	0	-	4Y	4	-	
2*4Y	3	-	3	-1	5Y	4	1	
2*5Y	7	-1	7	-1				
3*4Y	3	-	3	-1				
3*5Y	7	-1	7	-1				
4*5Y	4	-1	4	-				
5*7Y	12	1	13	-				
5*10Y	21	1	22	-				

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	39	13	49
今日	-1	40	13	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，其知识产权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、及时性或准确性等需求，且可未经通知而进行修改。所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang