



【2024-11-12】

中国央行今日进行 1255 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.50%，与此前持平。今日 183 亿元逆回购到期。资金面整体偏紧。7d repo fixing：1.9%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing：1.8590%，较上一交易日下降 0.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.71%附近，后震荡成交在 1.7125%-1.6875%区间附近，午盘报收 69.25/68.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.6925%-1.67%区间附近，报收 67/66.75。1y repo 全天震荡成交在 1.665%-1.64%区间附近，报收 64.5/64。

其他期限，6m repo 成交在 1.7675%-1.7725%附近，9m repo 成交在 1.6975%-1.7025%点位，2y repo 成交在 1.5875%-1.61%区间附近。3y repo 成交在 1.60%-1.61%附近，4y repo 成交在 1.645%-1.66%附近，曲线方面，6mx9m repo 成交在 -07 点位，9mx1y repo 成交在 -04.5bp 点位，2x5y repo 成交在 09.5bp-10bp 区间附近，1x2y repo 成交在 -5.5bp 区间附近，3x4y repo 成交在 04.5bp-05bp 附近，2x4y repo 成交在 05bp，4x5y repo 成交在 04.5bp 点位，1x5y repo 成交在 03.5bp-05bp 区间附近，报收 02.75/02.25，曲线走平。

Shibor 端，1y shibor 报收 67/65.75，5y shibor 报收 72/70.5。其他期限，未闻成交。曲线方面，1x5y shibor 报收 06.5/04。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

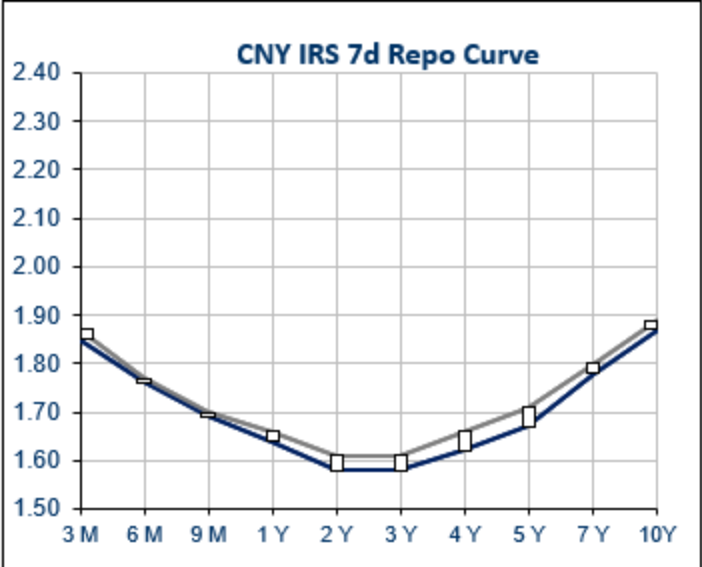
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/11/12 星期二

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	1.85	-2				3 M	1.6	-						
6 M	1.76	-1	6 M	1.8	-1	6 M	1.6	-						
9 M	1.69	-1	9 M	1.72	-2	9 M	1.6	-						
1 Y	1.64	-2	1 Y	1.67	-1	1 Y	1.5	-				1Y	1.63	-2
2 Y	1.58	-3	2 Y	1.61	-2	2 Y	1.5	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.56	-4
3 Y	1.58	-3	3 Y	1.62	-2	3 Y	1.6	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.57	-3
4 Y	1.62	-4	4 Y	1.66	-3				4 Y	1.8	-	4Y	1.63	-4
5 Y	1.67	-4	5 Y	1.71	-4				5 Y	1.8	-	5Y	1.63	-5
7 Y	1.78	-2	7 Y	1.83	-2				7 Y	1.8	-			
10Y	1.87	-2	10Y	1.92	-2				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	2.00	3M Shibor	1.859	-0.30	O-N Shibor	1.525	8.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-9	1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-7	-	-8	-1				
9M*1Y	-5	-1	-5	1	6M	4	-	
1*2Y	-6	-1	-6	-1	9M	3	-1	
1*3Y	-6	-1	-5	-1	1Y	3	1	
1*4Y	-2	-2	-1	-2	2Y	3	1	
1*5Y	3	-2	4	-3	3Y	4	1	
2*3Y	0	-	1	-	4Y	4	1	
2*4Y	4	-1	5	-1	5Y	4	-	
2*5Y	9	-1	10	-2				
3*4Y	4	-1	4	-1				
3*5Y	9	-1	9	-2				
4*5Y	5	-	5	-1				
5*7Y	11	2	12	2				
5*10Y	20	2	21	2				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	12	9	8	4	4	5	7
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	12	50
今日	1	42	14	52



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、出价、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