



【2024-02-05】

中国央行今日开展 1000 亿元 14 天期逆回购操作，中标利率为 1.95%，与此前持平，因今日有 5000 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 4000 亿元。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 1.9310%，与上一交易日下降 1.94bp，3m shibor fixing: 2.3500%，与上一交易日下降 1.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.175%附近，后震荡上行成交在 2.17%-2.185%，午盘报收 18.25/17.75。中午回来，5y repo 震荡回落成交在 2.185%-2.17%区间附近，尾盘报收 17/16.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.9775%-1.9575%区间附近，尾盘报收 96/95.75。曲线方面，1x5y repo 报收 21/20.75。

Shibor 端，1y shibor 报收 23/22，5y shibor 成交在 2.395%-2.41%附近，报收 40/39.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 17.75/16.75。基差方面，1y basis 报收 27/26.25，5y basis 报收 22.75/22.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2024/2/5 Monday

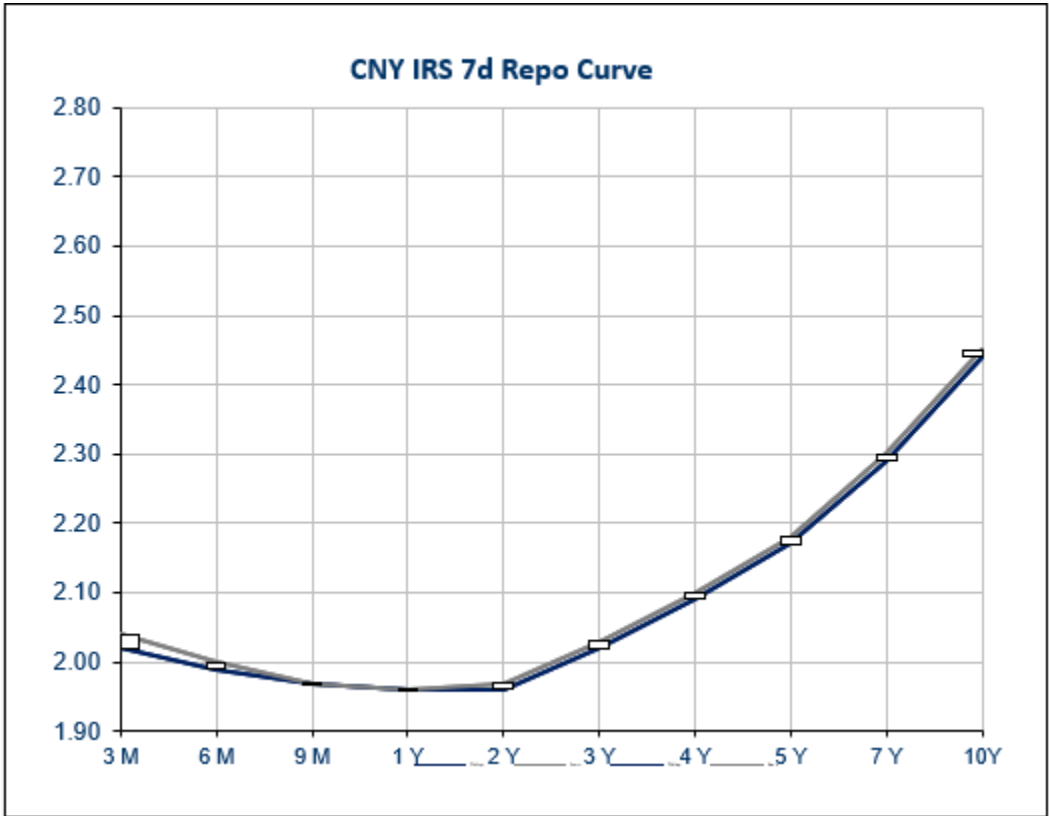
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd												OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO					
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365					
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp			
3 M	2.02	-2				3 M	1.74	-									
6 M	1.99	-1	6 M	2.27	-	6 M	1.8	-									
9 M	1.97	-	9 M	2.23	2	9 M	1.8	-									
1 Y	1.96	-	1 Y	2.23	1	1 Y	1.88	5				1Y	1.95	-			
2 Y	1.96	-1	2 Y	2.22	1	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-			
3 Y	2.02	-1	3 Y	2.26	1	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.98	-1			
4 Y	2.09	-1	4 Y	2.33	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.02	-1			
5 Y	2.17	-1	5 Y	2.4	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.11	-2			
7 Y	2.29	-1	7 Y	2.5	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.44	-1	10Y	2.56	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.931	-2.34	3M Shibor	2.35	-1.30	O-N Shibor	1.68	-3.10	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-2	1	-4	2			
9M*1Y	-1	-	0	-1	6M	28	1
1*2Y	0	-1	-1	-	9M	26	2
1*3Y	6	-1	3	-	1Y	27	1
1*4Y	13	-1	10	-1	2Y	26	-
1*5Y	21	-1	17	-1	3Y	24	-
2*3Y	6	-	4	-	4Y	24	1
2*4Y	13	-	11	-1	5Y	23	-
2*5Y	21	-	18	-1			
3*4Y	7	-	7	-1			
3*5Y	15	-	14	-1			
4*5Y	8	-	7	-			
5*7Y	12	-	10	-			
5*10Y	27	-	16	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	48	46	46	44	44	47	48
今日	48	46	46	44	44	47	48

Bond	230022/5y	230018/5y	230208/5y	230215/5y
Swap	repo	repo	repo	repo

昨日	10	29	19	45
今日	11	28	20	45



联系人: Ruby Wu
邮箱: viaoting.bu@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。所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang