



【2024-02-21】

中国央行今日进行 490 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。今日逆回购有 3960 亿元到期。资金面整体均衡。7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing: 2.2430%，与上一交易日下降 2.7bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.18%附近，后震荡成交在 2.18%-2.19%区间附近，午盘报收 18.75/18.25。中午回来，5y repo 稍微震荡上行，最高成交到 2.195%附近，后又有所回调，成交在 2.19%-2.18%附近，报收 18/17.75。1y repo 全天震荡成交在 1.95%-1.9575%区间附近，尾盘报收 95/94.75。其他期限，6m repo 成交在 1.9625%附近，9m repo 成交在 1.95%附近，2y repo 成交在 1.955%-1.96%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在 00bp 附近，1x2y repo 成交在 0.75-0.5bp 附近，1x5y repo 成交在 23-23.25bp 附近，报收 23/22.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 16.5/16，5y shibor 报收 41/40.5。基差方面，1y basis 报收 21.75/21.25，5y basis 报收 23/22.75。

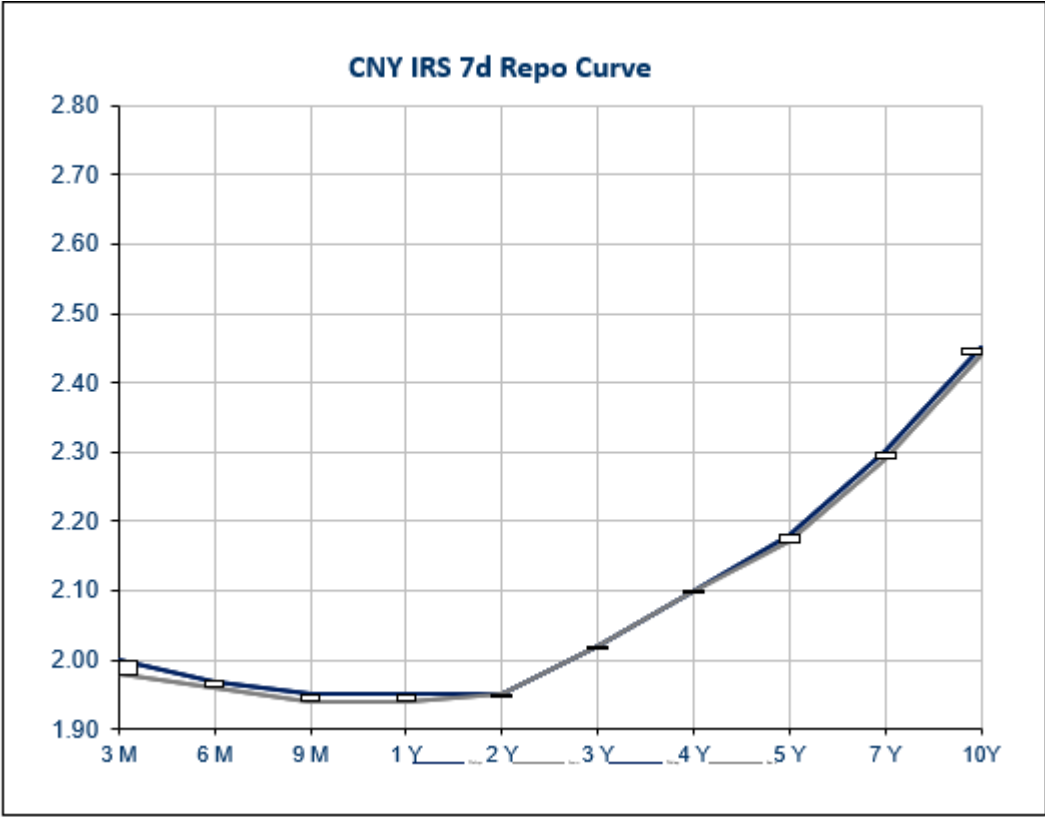
其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/2/21 Wednesday

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	2	2				3 M	1.74	-						
6 M	1.97	1	6 M	2.19	-2	6 M	1.8	-						
9 M	1.95	1	9 M	2.14	-2	9 M	1.8	-						
1 Y	1.95	1	1 Y	2.16	-2	1 Y	1.9	-				1Y	1.94	1
2 Y	1.95	-	2 Y	2.18	-1	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	1
3 Y	2.02	-	3 Y	2.24	-2	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.98	1
4 Y	2.1	-	4 Y	2.33	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.02	1
5 Y	2.18	1	5 Y	2.41	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.12	1
7 Y	2.3	1	7 Y	2.51	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.45	1	10Y	2.57	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	5.00	3M Shibor	2.243	-2.70	O-N Shibor	1.698	6.80	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	-3	-1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	-2	-	-5	-			
9M*1Y	0	-	2	-	6M	22	-3
1*2Y	0	-1	2	1	9M	19	-3
1*3Y	7	-1	8	-	1Y	21	-3
1*4Y	15	-1	17	1	2Y	23	-
1*5Y	23	-	25	2	3Y	22	-
2*3Y	7	-	6	-1	4Y	23	-1
2*4Y	15	-	15	-	5Y	23	-
2*5Y	23	1	23	1			
3*4Y	8	-	9	1			
3*5Y	16	1	17	2			
4*5Y	8	1	8	1			
5*7Y	12	-	10	-			
5*10Y	27	-	16	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	45	41	39	35	34	34	35
Bond	230022/5y	230018/5y	230208/5y	230215/5y			
Swap	repo	repo	repo	repo	36	36	36
昨日	10	28	18	45			
今日	09	27	17	44			



联系人: Ruby Su
邮箱: xlouting.bu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯

免责声明:

以上所登及附送的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供口提供信息, 且为保密的或/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披露免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN