



【2024-01-31】

中国央行公开市场今日进行 5440 亿元 7 天期逆回购操作，利率 1.8%，与此前持平。今日有 4630 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing: 2.35%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 2.3880%，与上一交易日下降 1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.155%附近，后震荡上行，成交在 2.16%-2.19%区间附近，午盘报收 18.75/18.5。中午回来，受消息面影响，5y repo 稍微震荡下行，成交在 2.185%-2.1725%区间附近，报收 18.75/18.5。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.9475%-1.99%区间附近，尾盘报收 97.75/97。其他期限，2y repo 成交在 1.985%-1.965%附近，3y repo 成交在 2.04%-2.025%区间附近。曲线方面，2x3y repo 成交在 05.5bp 附近，3x5y repo 成交在 15bp 附近，2x5y repo 成交在 20.5bp 附近，1x5y repo 成交在 21bp 附近，报收 21.25/21。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 23.25/22.5，5y shibor 报收 41/40。曲线方面，1x5y shibor 报收 17.5/16.5。基差方面，1y basis 报收 26/25.25，5y basis 报收 22.5/21.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

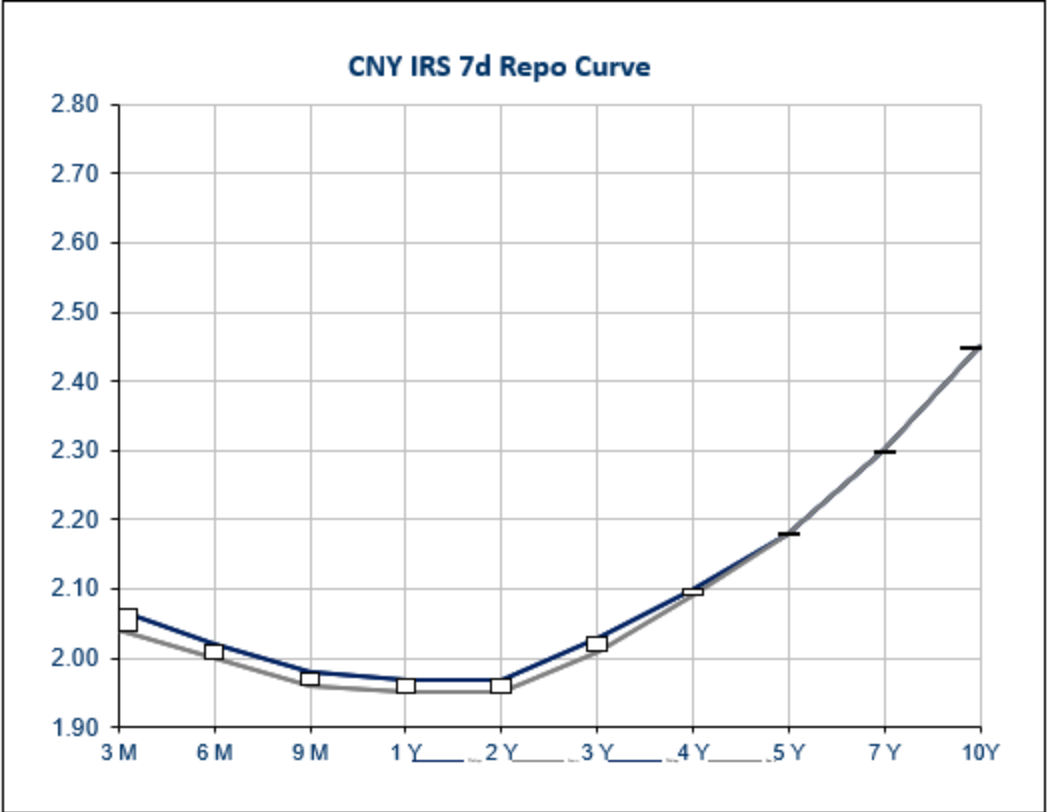
2024/1/31 Wednesday

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	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	2.07	3				3 M	1.74	-						
6 M	2.02	2	6 M	2.29	2	6 M	1.8	3						
9 M	1.98	2	9 M	2.23	1	9 M	1.8	5						
1 Y	1.97	2	1 Y	2.23	2	1 Y	1.78	5				1Y	1.96	2
2 Y	1.97	2	2 Y	2.22	1	2 Y	1.95	5	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	1
3 Y	2.03	2	3 Y	2.27	2	3 Y	2	5	3 Y	1.77	-	3Y	1.98	1
4 Y	2.1	1	4 Y	2.33	2				4 Y	1.8	-	4Y	2.03	1
5 Y	2.18	-	5 Y	2.4	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.13	2
7 Y	2.3	-	7 Y	2.51	1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.45	-	10Y	2.57	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.35	-	3M Shibor	2.388	-1.00	O-N Shibor	1.708	9.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	-5	-1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	-4	-	-6	-1			
9M*1Y	-1	-	0	1	6M	27	-
1*2Y	0	-	-1	-1	9M	25	-1
1*3Y	6	-	4	-	1Y	26	-
1*4Y	13	-1	10	-	2Y	25	-
1*5Y	21	-2	17	-1	3Y	24	-
2*3Y	6	-	5	1	4Y	23	1
2*4Y	13	-1	11	1	5Y	22	-
2*5Y	21	-2	18	-			
3*4Y	7	-1	6	-			
3*5Y	15	-2	13	-1			
4*5Y	8	-1	7	-1			
5*7Y	12	-	11	-			
5*10Y	27	-	17	-			

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 Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	10	31	20	48
今日	11	29	20	46



联系人: Ruby Hu
邮箱: viaoting.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:
以上所述及附注的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息。其知识产权属于上海国际证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际证券”) 或其三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资策略或任何交易策略相关的推介、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。如有疑问请与贵行联系。所有陈述和保证均按明确条款声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang