



【2024-01-30】

中国央行今日开展 5630 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 4650 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 980 亿元。资金面均衡偏松。7d repo fixing: 2.35%，与上一交易日相比下降 15bp，3m shibor fixing: 2.3980%，与上一交易日相比下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.205%，5y repo 下行 tkn 至 2.185%后回升至 2.205%，期货开盘后一路上行，5y repo 随之一路震荡下行成交 2.1975%-2.175%，午盘报收 17.75/17。午后 5y repo 线下后上，gvn 至 2.165%后震荡上行成交在 2.1675%-2.1825%，尾盘 5y repo 下行 gvn 至 2.175%，报收 17.5/17。1y repo 随长端震荡成交在 1.97%-1.935%，尾盘报收 94.75/94.5。其他期限，2y repo 成交在 1.945%附近，3y repo 成交在 2.00%-2.01%附近。曲线方面，3x5y repo 成交在 17.5bp 附近, 1x5y repo 成交在 25bp-23bp，曲线走平，报收 23/22.25

Shibor 端交易寥寥，1y 报收 21.75/21，5y shibor 报收 39.25/38.5。基差方面，1y basis 报收 27/26.25，5y basis 成交在报收 21.75/21。其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

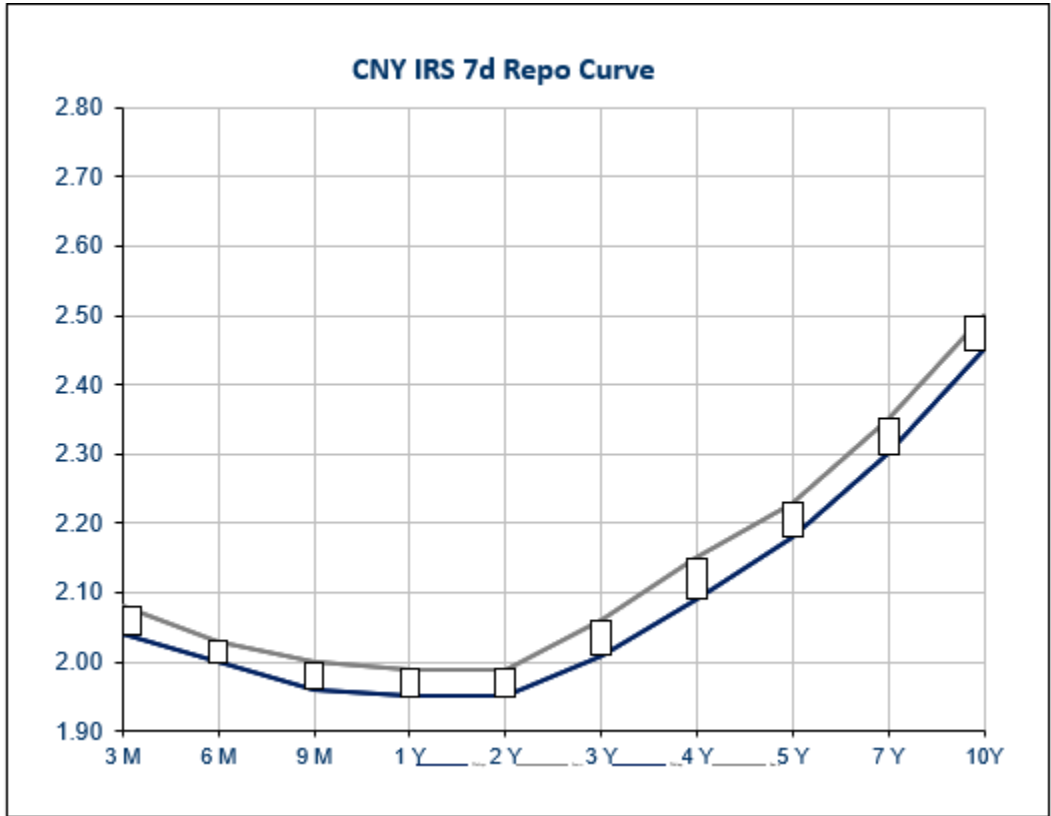
2024/1/30 Tuesday

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	2.04	-4				3 M	1.74	5									
6 M	2	-3	6 M	2.27	-2	6 M	1.77	5									
9 M	1.96	-4	9 M	2.22	-2	9 M	1.75	5									
1 Y	1.95	-4	1 Y	2.21	-3	1 Y	1.73	5				1Y	1.94	-3			
2 Y	1.95	-4	2 Y	2.21	-3	2 Y	1.9	5	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	-3			
3 Y	2.01	-5	3 Y	2.25	-4	3 Y	1.95	5	3 Y	1.77	-	3Y	1.97	-4			
4 Y	2.09	-6	4 Y	2.31	-5				4 Y	1.8	-	4Y	2.02	-5			
5 Y	2.18	-5	5 Y	2.39	-5				5 Y	1.8	-	5Y	2.11	-5			
7 Y	2.3	-5	7 Y	2.5	-5				7 Y	1.8	-						
10Y	2.45	-5	10Y	2.56	-5				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.35	-15.00	3M Shibor	2.398	-0.20	O-N Shibor	1.618	-11.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4 1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4 -1	-5 -				
9M*1Y	-1 -	-1 -1	6M	27	1	
1*2Y	0 -	0 -	9M	26	2	
1*3Y	6 -1	4 -1	1Y	26	1	
1*4Y	14 -2	10 -2	2Y	26	-	
1*5Y	23 -1	18 -2	3Y	24	-	
2*3Y	6 -1	4 -1	4Y	22	1	
2*4Y	14 -2	10 -2	5Y	21	-	
2*5Y	23 -1	18 -2				
3*4Y	8 -1	6 -1				
3*5Y	17 -	14 -1				
4*5Y	9 1	8 -				
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	19	47



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货币经纪有限公司 (以下简称“上海国际货币”) 或其三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、服务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。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