



【2024-02-26】

中国央行今日开展 580 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。因今日有 1370 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 1920 亿元。7d repo fixing: 2.15%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 2.2080%，与上一交易日下降 0.6bp。

Repo 端，5y repo 早盘震荡下行成交在 2.16%-2.15%，午盘报收 15.25/14.75。午后 5y repo 继续下行成交在 2.15%-2.1325%，尾盘报收 13.5/13。1y repo 上行成交在 1.9325%-1.9425%，午盘报收 94.25/94，午后 1y repo 小幅下行成交在 1.94%-1.9325%附近，尾盘报收 93.25/92.75。其他期限，2y repo 成交在 1.94%，3y repo 成交在 1.99%。曲线方面，1x2y repo 成交在 0.5bp，3×5y repo 成交在 14.75bp，1x5y repo 成交在 21.25-20.25bp，报收 20.25/20.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.1525%-2.1425%附近，报收 14.5/14.25，5y shibor 报收 36.5/35.25。曲线方面。1×5y shibor 报收 22.5/21。基差方面，1y basis 成交在 21bp, 报收 21.5/20.75，5y basis 报收 22.75/21.75。

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

2024/2/26 Monday

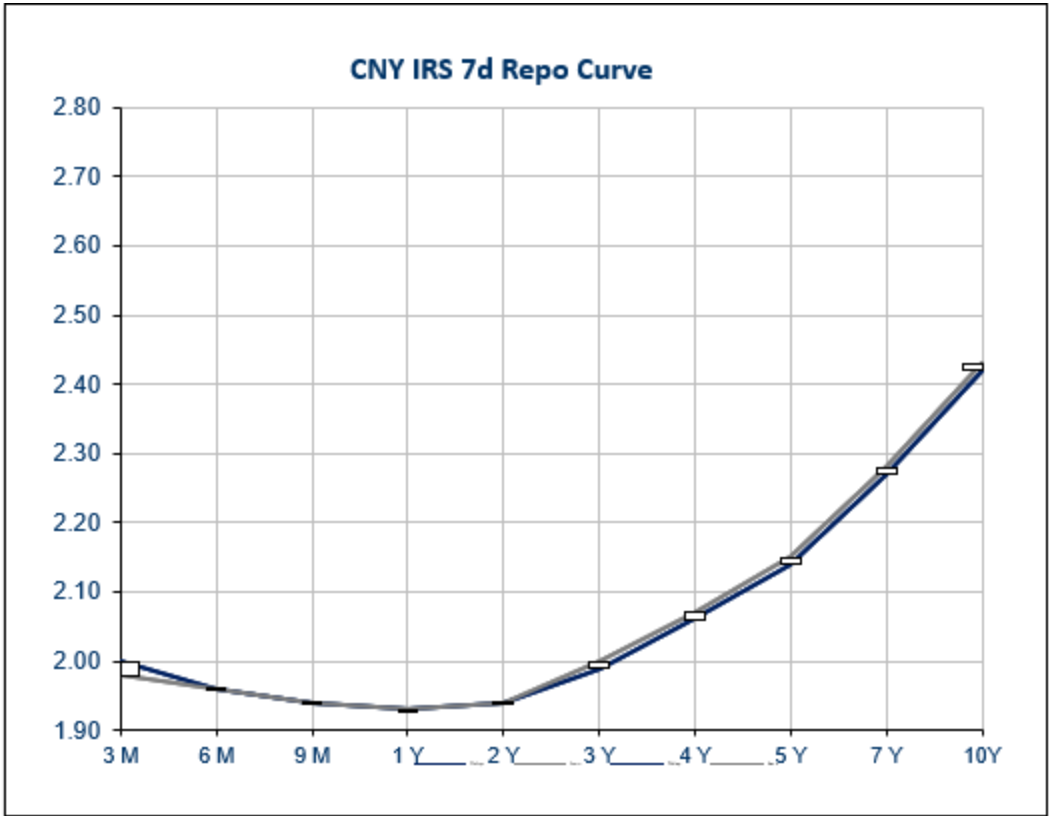
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	2	2				3 M	1.74	-						
6 M	1.96	-	6 M	2.17	-1	6 M	1.8	-						
9 M	1.94	-	9 M	2.12	-1	9 M	1.8	-						
1 Y	1.93	-	1 Y	2.15	-	1 Y	1.9	-				1Y	1.92	-
2 Y	1.94	-	2 Y	2.15	-1	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.9	-
3 Y	1.99	-1	3 Y	2.21	-	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.95	-1
4 Y	2.06	-1	4 Y	2.28	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2	-
5 Y	2.14	-1	5 Y	2.36	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.08	-2
7 Y	2.27	-1	7 Y	2.47	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.42	-1	10Y	2.53	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.15	-5.00	3M Shibor	2.208	-0.60	O-N Shibor	1.779	3.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-2		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-2	-	-5 -				
9M*1Y	-1	-	3 1	6M	21	-1	
1*2Y	1	-	0 -1	9M	18	-1	
1*3Y	6	-1	6 -	1Y	22	-	
1*4Y	13	-1	13 -1	2Y	21	-	
1*5Y	21	-1	21 -1	3Y	22	-	
2*3Y	5	-1	6 1	4Y	22	-	
2*4Y	12	-1	13 -	5Y	22	-	
2*5Y	20	-1	21 -				
3*4Y	7	-	7 -1				
3*5Y	15	-	15 -1				
4*5Y	8	-	8 -				
5*7Y	13	-	11 -				
5*10Y	28	-	17 -				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	45	43	41	38	36	36	36
今日	45	43	41	38	36	36	36

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

昨日	09	28	16	45
今日	09	27	16	43



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:

以上所发及附发的所有信息 (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明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang