



【2024-02-28】

中国央行今日进行 3240 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 490 亿元到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 2.10%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 2.1989%，与上一交易日下降 0.51bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.15%附近，后震荡上行，成交在 2.1475%-2.165%区间附近，后回调成交到 2.15%附近，午盘报收 15/14.5。中午回来，5y repo 继续震荡下行，成交在 2.145%-2.1325%区间附近，报收 14/13.5。1y repo 全天震荡成交在 1.955%-1.9325%区间附近，尾盘报收 94/93.5。其他期限，6m repo 成交在 1.975%附近，9m repo 成交在 1.94%附近，2y repo 成交在 1.9425%-1.935%附近，4y repo 成交在 2.075%附近。曲线方面，9mx1y 成交在-0.5bp 附近，4x5y repo 成交在 0.75bp 附近，1x5y repo 成交在 21-20bp 附近，报收 20.25/19.75。

Shibor 端，9m shibor 成交在 2.13%附近，1y shibor 成交在 2.15%-2.145%附近，报收 15.5/15，5y shibor 报收 36.75/36。曲线方面，9x1y shibor 成交在 2bp 附近，基差方面，9m basis 成交在 19bp 附近，1y basis 成交在 21.25-21.5bp 附近，报收 22/21.5，5y basis 报收 23/22.25。

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

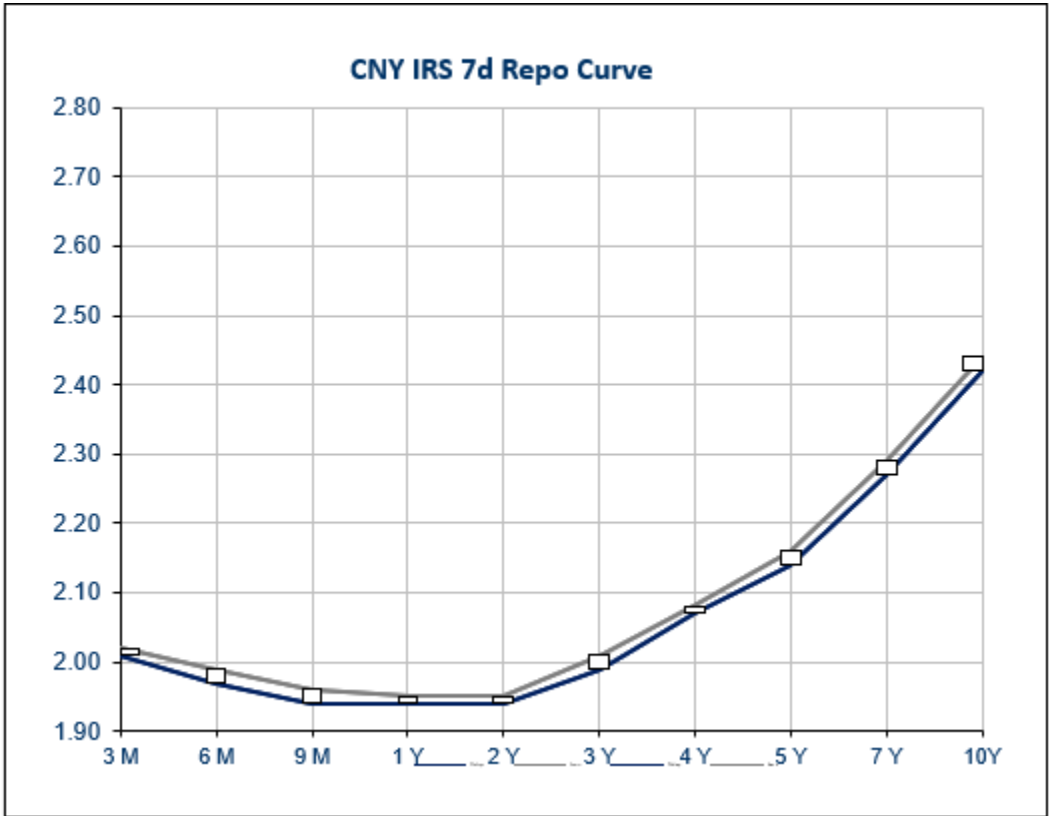
2024/2/28 Wednesday

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	2.01	-1				3 M	1.74	-						
6 M	1.97	-2	6 M	2.17	-2	6 M	1.8	-						
9 M	1.94	-2	9 M	2.13	-2	9 M	1.8	-						
1 Y	1.94	-1	1 Y	2.15	-1	1 Y	1.9	-				1Y	1.93	-1
2 Y	1.94	-1	2 Y	2.16	-1	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.91	-2
3 Y	1.99	-2	3 Y	2.21	-2	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.95	-2
4 Y	2.07	-1	4 Y	2.29	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2	-2
5 Y	2.14	-2	5 Y	2.36	-2				5 Y	1.8	-	5Y	2.08	-2
7 Y	2.27	-2	7 Y	2.47	-2				7 Y	1.8	-			
10Y	2.42	-2	10Y	2.53	-2				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.10	-5.00	3M Shibor	2.1989	-0.51	O-N Shibor	1.7056	-11.34	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4 -1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3 -	-4 -				
9M*1Y	0 1	2 1	6M	20	-	
1*2Y	0 -	1 -	9M	19	-	
1*3Y	5 -1	6 -1	1Y	21	-	
1*4Y	13 -	14 -	2Y	22	-	
1*5Y	20 -1	21 -1	3Y	22	-	
2*3Y	5 -1	5 -1	4Y	22	-	
2*4Y	13 -	13 -	5Y	22	-	
2*5Y	20 -1	20 -1				
3*4Y	8 1	8 1				
3*5Y	15 -	15 -				
4*5Y	7 -1	7 -1				
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 Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	08	25	14	40
今日	08	25	14	41



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:

以上所述及所加的所有信息（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。其知识产仅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