



【2024-02-07】

中国央行今日开展 3960 亿元 14 天期逆回购操作，因今日有 5440 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1480 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日相比不变，3m shibor fixing: 2.3430%，与上一交易日下降 0.3bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.225%，后 tkn 至 2.235%，期货开盘后，5y repo 下行成交在 2.2325%-2.1975%区间附近，午盘报收 20/19.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.1975%-2.2025%区间附近，尾盘稍微下行 gvn 至 2.18%后上行成交在 2.1825%-2.19%，报收 18.75/18.25。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.9925%-1.9525%区间附近，尾盘报收 95.75/95.5。其他期限，9m repo 成交在 1.975%附近，2y repo 成交在 1.975%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在 -00.75bp 附近，1x2y repo 成交在 0.5bp 附近，2x5y repo 成交在 23bp 附近，1x5y repo 成交在 23.75bp-2.23bp 附近，报收 23.25/22.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 23.75/22.25，5y shibor 报收 42.5/41.75。基差方面，1y basis 报收 27.5/26.5，5y basis 报收 24/23.25。

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

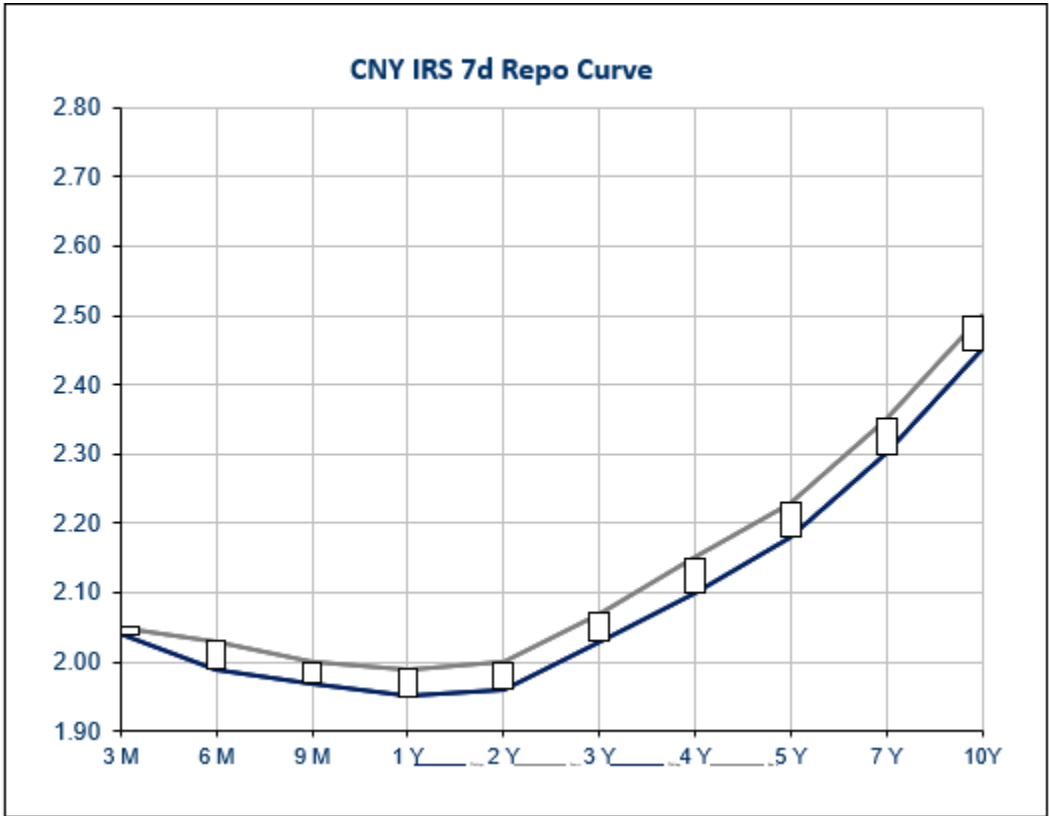
2024/2/7 Wednesday

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	2.04	-1				3 M	1.74	-						
6 M	1.99	-4	6 M	2.28	-3	6 M	1.8	-						
9 M	1.97	-3	9 M	2.23	-3	9 M	1.8	-						
1 Y	1.95	-4	1 Y	2.22	-3	1 Y	1.9	-				1Y	1.95	-4
2 Y	1.96	-4	2 Y	2.22	-4	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	-5
3 Y	2.03	-4	3 Y	2.27	-4	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.98	-5
4 Y	2.1	-5	4 Y	2.35	-4				4 Y	1.8	-	4Y	2.03	-5
5 Y	2.18	-5	5 Y	2.42	-4				5 Y	1.8	-	5Y	2.13	-5
7 Y	2.3	-5	7 Y	2.52	-4				7 Y	1.8	-			
10Y	2.45	-5	10Y	2.58	-4				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.95	-	3M Shibor	2.342	-0.30	O-N Shibor	1.716	-1.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	-5	-3			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	-2	1	-5	-			
9M*1Y	-2	-1	-1	-	6M	29	1
1*2Y	1	-	0	-1	9M	26	-
1*3Y	8	-	5	-1	1Y	27	1
1*4Y	15	-1	13	-1	2Y	26	-
1*5Y	23	-1	20	-1	3Y	24	-
2*3Y	7	-	5	-	4Y	25	1
2*4Y	14	-1	13	-	5Y	24	-
2*5Y	22	-1	20	-			
3*4Y	7	-1	8	-			
3*5Y	15	-1	15	-			
4*5Y	8	-	7	-			
5*7Y	12	-	10	-			
5*10Y	27	-	16	-			

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	28	20	44
今日	10	28	19	44



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:
以上所述及附带的信息 (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、投资策略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