



【2024-01-26】

中国央行今日开展 4610 亿元逆回购操作，因今日有 710 亿元逆回购到期，当日实现净投放 3900 亿元。资金面均衡偏紧。7d repo fixing: 2.40%，与上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing: 2.40%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.2625%，后一路震荡下行成交在 2.265%-2.2525%，午盘报收 25.5/25.25。午后 5y repo 震荡成交在 2.2575%-2.2525%，报收 25.75/25.5。1y repo 震荡成交在 2.02%-1.995%，尾盘报收 00.25/00。其他期限，1m repo 成交在 2.07%，3m repo 成交在 2.0775%-2.0525%，6m repo 成交在 2.04%-2.025%，9m repo 成交 2.02%，2y repo 成交在 2.0175%。曲线方面，3mx6m repo 成交在-3bp，6mx9m repo 成交在-2bp，9mx1y repo 成交在-0.25 bp，6mx1y repo 成交在-3bp 至-2.75bp 附近，1x2y repo 成交在 2bp，1x3y repo 成交 8.75bp 附近，3x5y repo 成交在 24bp-23.75bp，4x5y repo 成交在 8.5bp，1x5y repo 成交在 25bp-25.75bp，曲线走陡，报收 25.75/25.5。

Shibor 端，1y shibor 报收 26/25.5，5y shibor 报收 46.75/46.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 21/20.25。基差方面，1y basis 报收 26.25/25.5，5y basis 成交在报收 21.5/20.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

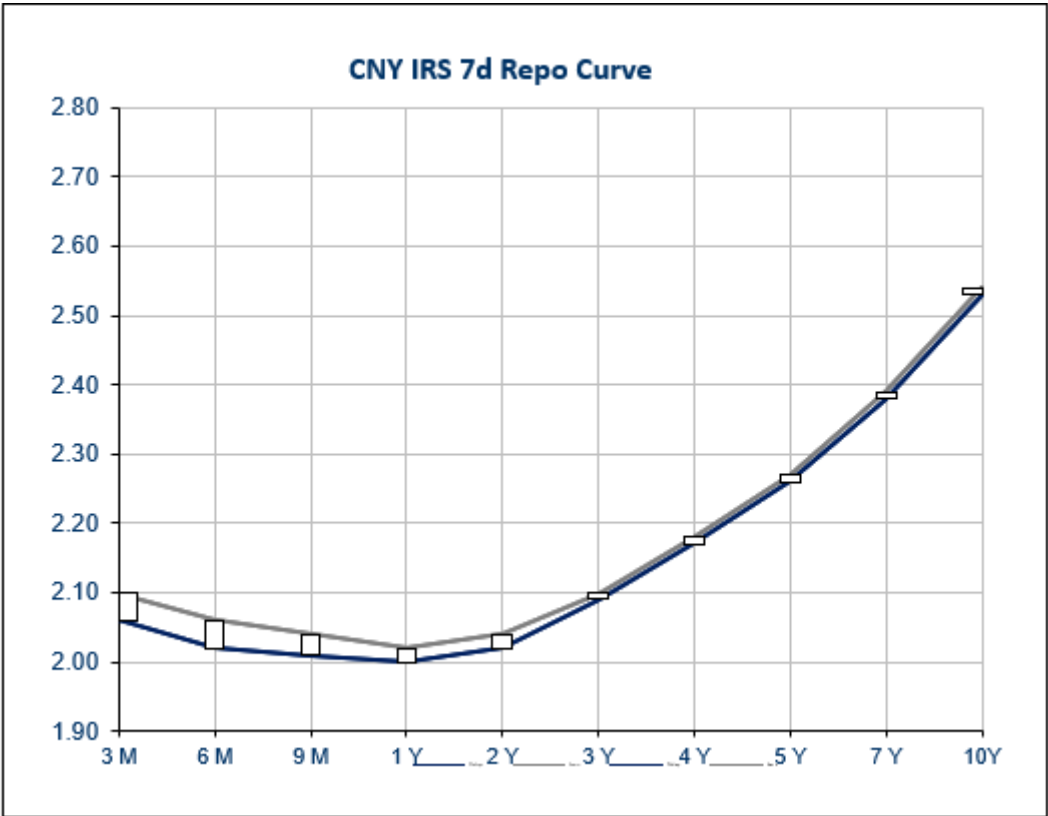
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/1/26 Friday

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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.06	-4				3 M	1.69	-						
6 M	2.02	-4	6 M	2.31	-2	6 M	1.72	-						
9 M	2.01	-3	9 M	2.26	-2	9 M	1.7	-						
1 Y	2	-2	1 Y	2.26	-2	1 Y	1.68	-				1Y	1.99	-3
2 Y	2.02	-2	2 Y	2.26	-2	2 Y	1.85	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.99	-3
3 Y	2.09	-1	3 Y	2.32	-1	3 Y	1.9	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.04	-2
4 Y	2.17	-1	4 Y	2.39	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.11	-1
5 Y	2.26	-1	5 Y	2.47	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.2	-1
7 Y	2.38	-1	7 Y	2.58	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.53	-1	10Y	2.64	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.40	5.00	3M Shibor	2.4	-	O-N Shibor	1.82	1.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-1	1	-5	-				
9M*1Y	-1	1	0	-	6M	29	2	
1*2Y	2	-	0	-	9M	25	1	
1*3Y	9	1	6	1	1Y	26	-	
1*4Y	17	1	13	2	2Y	24	-	
1*5Y	26	1	21	1	3Y	23	-	
2*3Y	7	1	6	1	4Y	22	1	
2*4Y	15	1	13	2	5Y	21	-	
2*5Y	24	1	21	1				
3*4Y	8	-	7	1				
3*5Y	17	-	15	-				
4*5Y	9	-	8	-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	8	27	17	43
今日	9	28	18	44



联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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联证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国联证券”) 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、定价、建议或诱导。“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处理。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN