



【2024-02-06】

 中国人民银行今日进行 3390 亿元 14 天期逆回购操作，利率 1.95%，与此前持平。今日有 5630 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日上升 1.9bp，3m shibor fixing: 2.3450%，与上一交易日下降 0.5bp。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.18%附近，后震荡成交在 2.18%-2.1925%区间附近，午盘报收 19/18.75。中午回来，国债期货下行，5y repo 震荡上行，成交在 2.20%-2.2375%区间附近，尾盘稍微回调，成交在 2.235%-2.225%附近，报收 23/22.5。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.975%-2.00%区间附近，尾盘报收 99.5/99。其他期限，6m repo 成交在 2.01%附近，9m repo 成交在 1.9825%附近，2y repo 成交在 1.9875%-1.9925%附近，4y repo 成交在 2.1325%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 -2.75bp 附近，1x2y repo 成交在 0.5-0.75bp 附近，4x5y repo 成交在 8.5bp 附近，1x5y repo 成交在 22-23.5bp 附近，曲线走陡，报收 24/23.5。

 Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 26/25，5y shibor 报收 46.75/45.75。基差方面，1y basis 报收 26.5/25.5，5y basis 报收 24/23。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2024/2/6

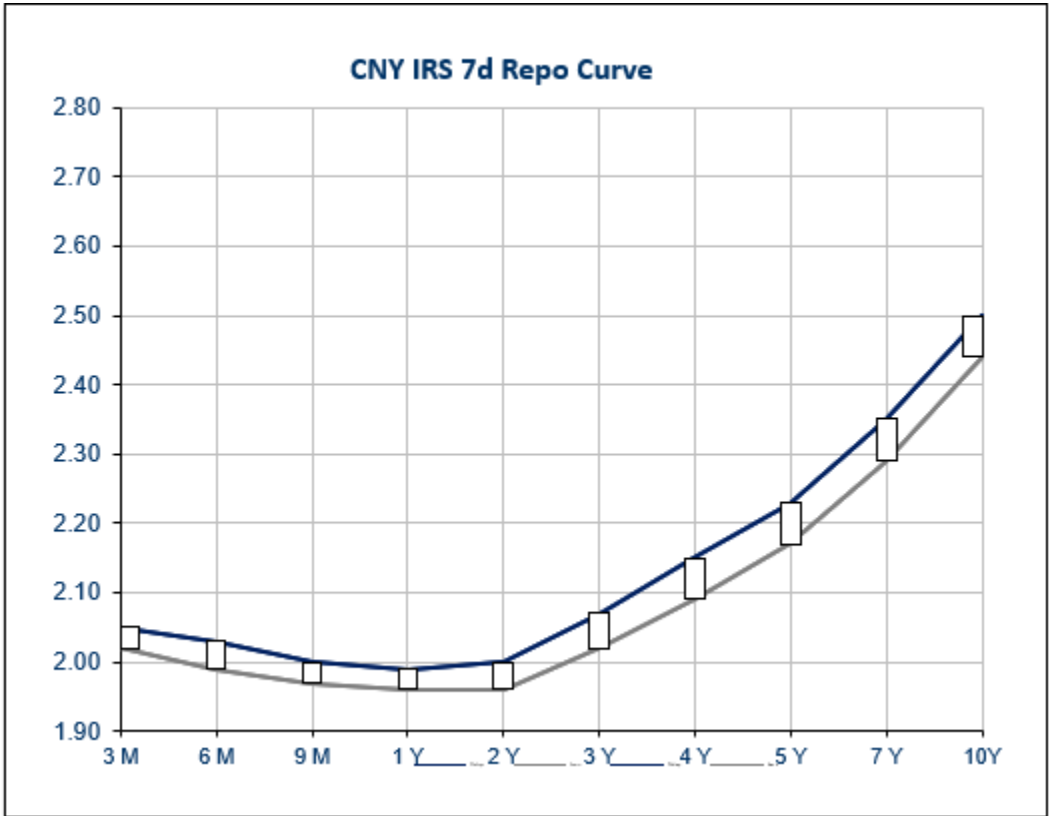
Tuesday

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	2.05	3				3 M	1.74	-						
6 M	2.03	4	6 M	2.31	4	6 M	1.8	-						
9 M	2	3	9 M	2.26	3	9 M	1.8	-						
1 Y	1.99	3	1 Y	2.25	2	1 Y	1.9	2				1Y	1.99	4
2 Y	2	4	2 Y	2.26	4	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.98	4
3 Y	2.07	5	3 Y	2.31	5	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.03	5
4 Y	2.15	6	4 Y	2.39	6				4 Y	1.8	-	4Y	2.08	6
5 Y	2.23	6	5 Y	2.46	6				5 Y	1.8	-	5Y	2.18	7
7 Y	2.35	6	7 Y	2.56	6				7 Y	1.8	-			
10Y	2.5	6	10Y	2.62	6				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.95	1.90	3M Shibor	2.345	-0.50	O-N Shibor	1.727	4.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	-1	-5	-1				
9M*1Y	-1	-	-1	-1	6M	28	-	
1*2Y	1	1	1	2	9M	26	-	
1*3Y	8	2	6	3	1Y	26	-1	
1*4Y	16	3	14	4	2Y	26	-	
1*5Y	24	3	21	4	3Y	24	-	
2*3Y	7	1	5	1	4Y	24	-	
2*4Y	15	2	13	2	5Y	23	-	
2*5Y	23	2	20	2				
3*4Y	8	1	8	1				
3*5Y	16	1	15	1				
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	11	28	20	45
今日	10	28	20	44



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:

以上所述及附加的所有信息 (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, 且可能随时进行修订, 所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang