



【2024-02-29】

中国央行今日开展 1170 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 580 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 590 亿元。7d repo fixing: 2.05%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 2.1930%，与上一交易日下降 0.59bp。

Repo 端，5y repo 早盘下行成交在 2.1375%-2.13%，午盘报收 14/13.5。午后 5y repo 震荡上行成交在 2.135%-2.15%，报收 15/14.5。1y repo 全天窄幅震荡成交在 1.9325%-1.925%，尾盘报收 93.25/92.75。其他期限，2y repo 成交在 1.9275%。曲线方面，1×2y repo 成交在 0.75bp，1x5y repo 成交在 20.5-21.75bp，报收 22/21.25。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.135%-2.1325%，报收 13.75/13.25，5y shibor 成交在 2.36%，报收 37.5/36.75，9m shibor 成交在 2.1125%-2.115%。曲线方面。9×1y repo 成交在 2-2.25bp，1×5y shibor 报收 24/23。基差方面，1y basis 成交在 20.5bp-20.75bp，报收 21/20.5，5y basis 成交在 22.25bp，报收 22.5/22.25。

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

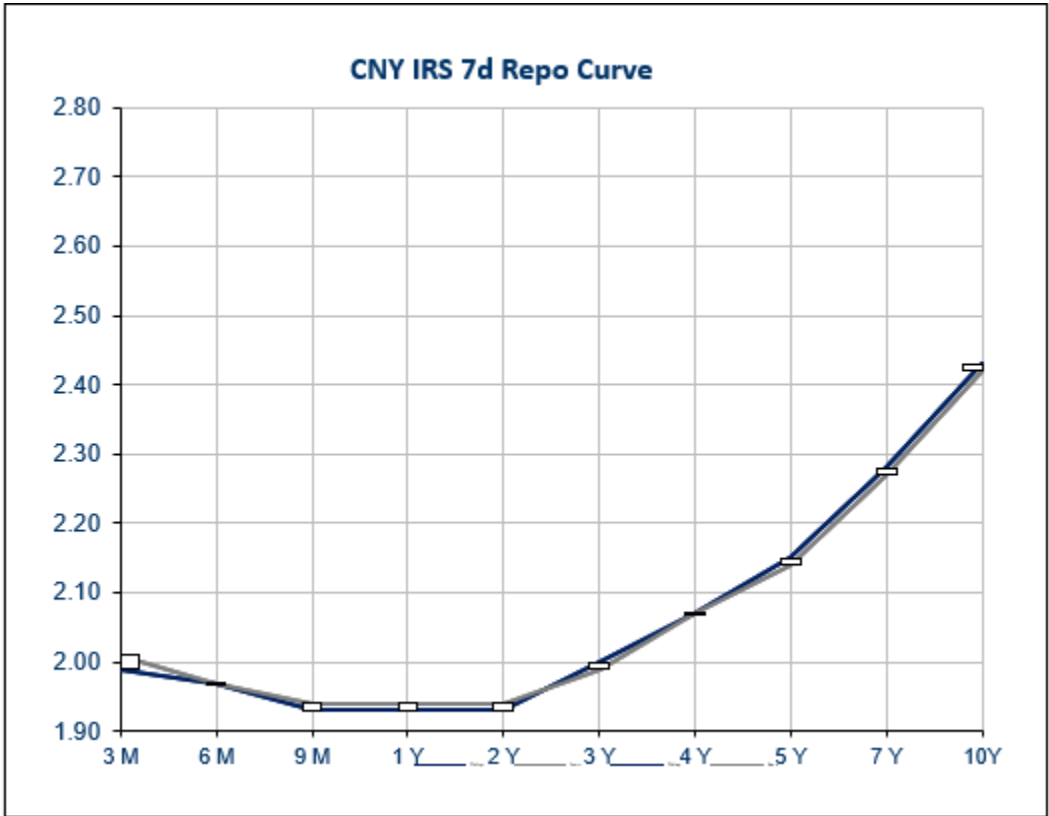
2024/2/29 Thursday

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	1.99	-2				3 M	1.74	-						
6 M	1.97	-	6 M	2.16	-1	6 M	1.8	-						
9 M	1.93	-1	9 M	2.11	-2	9 M	1.8	-						
1 Y	1.93	-1	1 Y	2.13	-2	1 Y	1.9	-				1Y	1.93	-
2 Y	1.93	-1	2 Y	2.14	-2	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.92	1
3 Y	2	1	3 Y	2.21	-	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.96	1
4 Y	2.07	-	4 Y	2.29	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.01	1
5 Y	2.15	1	5 Y	2.37	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.09	1
7 Y	2.28	1	7 Y	2.48	1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.43	1	10Y	2.54	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.05	-5.00	3M Shibor	2.193	-0.59	O-N Shibor	1.639	-6.66	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	2			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	-1	-5	-1				
9M*1Y	0	-	2	-	6M	19	-1	
1*2Y	0	-	1	-	9M	18	-1	
1*3Y	7	2	8	2	1Y	20	-1	
1*4Y	14	1	16	2	2Y	21	-	
1*5Y	22	2	24	3	3Y	21	-	
2*3Y	7	2	7	2	4Y	22	-	
2*4Y	14	1	15	2	5Y	22	-	
2*5Y	22	2	23	3				
3*4Y	7	-1	8	-				
3*5Y	15	-	16	1				
4*5Y	8	1	8	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	41
今日	07	24	13	36



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, 且可能随时进行调整, 所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang