



【2024-02-27】

中国央行今日开展 3840 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 410 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 3430 亿元。7d repo fixing: 2.15%，与上一交易日相比不变，3m shibor fixing: 2.2040%，与上一交易日下降 0.4bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交在 2.12%，后 tkn 至 2.1325%，5y repo 略微回调成交在 2.13%-2.125%后上行成交 tkn 至 2.15%，午盘报收 15.25/15。午后 5y repo 成交在 2.145%-2.165%，尾盘略微下行报收 15.75/15.5。1y repo 随长端成交在 1.9325%-2.1575%，尾盘报收 95.25/94.75。其他期限，2y repo 成交在 1.94%附近，3y repo 成交在 1.9775%-1.995%附近。曲线方面，6mx1y repo 成交在-3.25bp 到-4bp 附近，1x3y repo 成交在 05.5bp 附近，3x5y repo 成交在 14.5bp-14.25bp 附近，4x5y repo 成交在 08bp 附近，1x5y repo 成交在 19.75bp-20.5bp 附近，报收 20.75/20.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.1625%-2.16%附近，报收 15.75/15.25，5y shibor 成交在 2.345%-2.3825%附近，报收 38.25/37.5。曲线方面。1×5y shibor 成交在 22bp 附近，报收 22.5/21.5。基差方面，1y basis 报收 21/20.5，5y basis 报收 22.75/22。

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

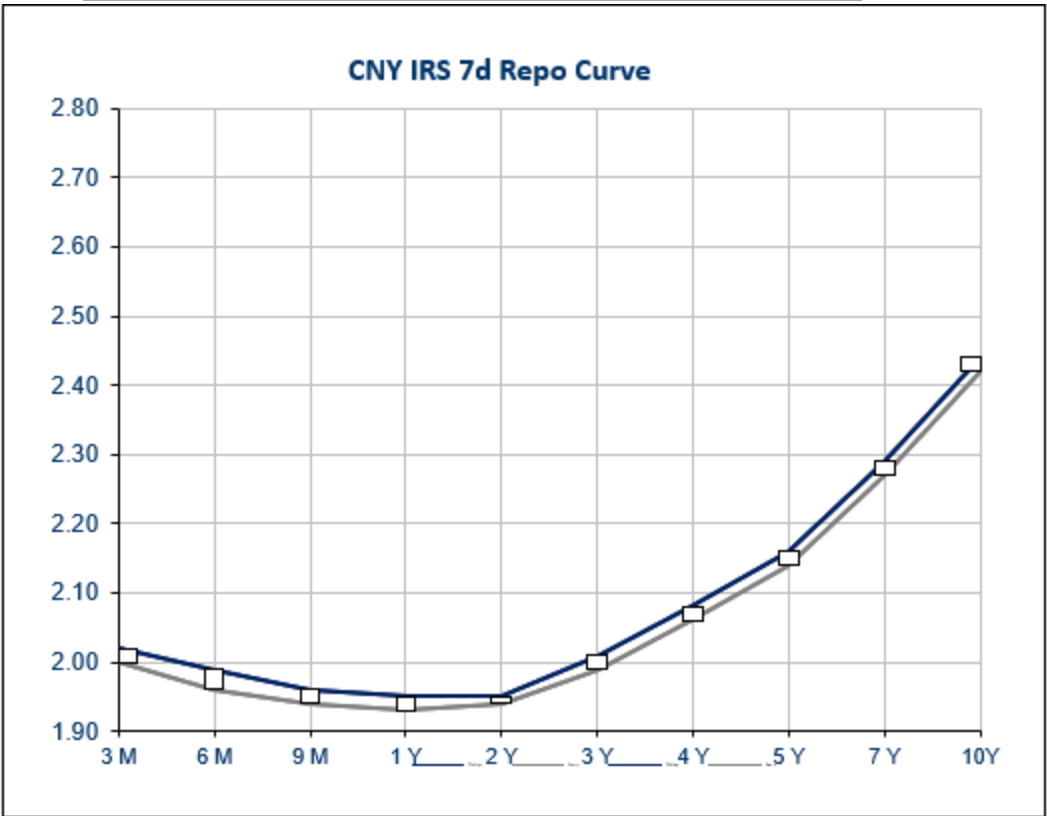
2024/2/27 Tuesday

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	2.02	2				3 M	1.74	-						
6 M	1.99	3	6 M	2.19	2	6 M	1.8	-						
9 M	1.96	2	9 M	2.15	3	9 M	1.8	-						
1 Y	1.95	2	1 Y	2.16	1	1 Y	1.9	-				1Y	1.94	2
2 Y	1.95	1	2 Y	2.17	2	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	3
3 Y	2.01	2	3 Y	2.23	2	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.97	2
4 Y	2.08	2	4 Y	2.3	2				4 Y	1.8	-	4Y	2.02	2
5 Y	2.16	2	5 Y	2.38	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.1	2
7 Y	2.29	2	7 Y	2.49	2				7 Y	1.8	-			
10Y	2.44	2	10Y	2.55	2				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.15	-	3M Shibor	2.204	-0.40	O-N Shibor	1.819	4.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	-1	-4	1				
9M*1Y	-1	-	1	-2	6M	20	-1	
1*2Y	0	-1	1	1	9M	19	1	
1*3Y	6	-	7	1	1Y	21	-1	
1*4Y	13	-	14	1	2Y	22	-	
1*5Y	21	-	22	1	3Y	22	-	
2*3Y	6	1	6	-	4Y	22	-	
2*4Y	13	1	13	-	5Y	22	-	
2*5Y	21	1	21	-				
3*4Y	7	-	7	-				
3*5Y	15	-	15	-				
4*5Y	8	-	8	-				
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	09	27	16	43
今日	08	25	14	40



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:
以上所述及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或有预期的信息, 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”) 或其三方。“信息”不能也不应被解释为任何金融工具、投资建议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声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang