



【2024-03-01】

中国央行今日开展 100 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 2470 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2370 亿元。本周，中国央行进行 11640 亿元逆回购操作，因本周有 5320 亿元逆回购到期，本周实现净投放 6320 亿元。7d repo fixing: 2.00%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 2.1820%，与上一交易日下降 1.1bp。

数据方面，中国 2 月财新制造业 PMI 50.9，预期 50.6，前值 50.8。中国 2 月官方制造业 PMI 49.1，前值 49.2。

Repo 端，5y repo 早盘上行成交在 2.1525%-2.17%，午盘报收 17/16.75。午后 5y repo tkn 至 2.1875%后先下后上成交在 2.1725%-2.1925%，报收 18.5/18。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.9325%-1.9575%，尾盘报收 95.25/94.75。其他期限，2y repo 成交在 1.9475%-1.97%附近。曲线方面，1×2y repo 成交在 1.75bp-02bp 附近，2x5y repo 成交在 21.5bp-22bp 附近，3x5y repo 成交在 15.5bp，1x5y repo 成交在 22.5-23.5bp，报收 23.25/23。

Shibor 端，1y shibor 报收 16.25/15.75，5y shibor 成交报收 42/40.25。曲线方面。1×5y shibor 报收 26/23.75。基差方面，1y basis 成交报收 21.5/20.75，5y basis 报收 23.5/22.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

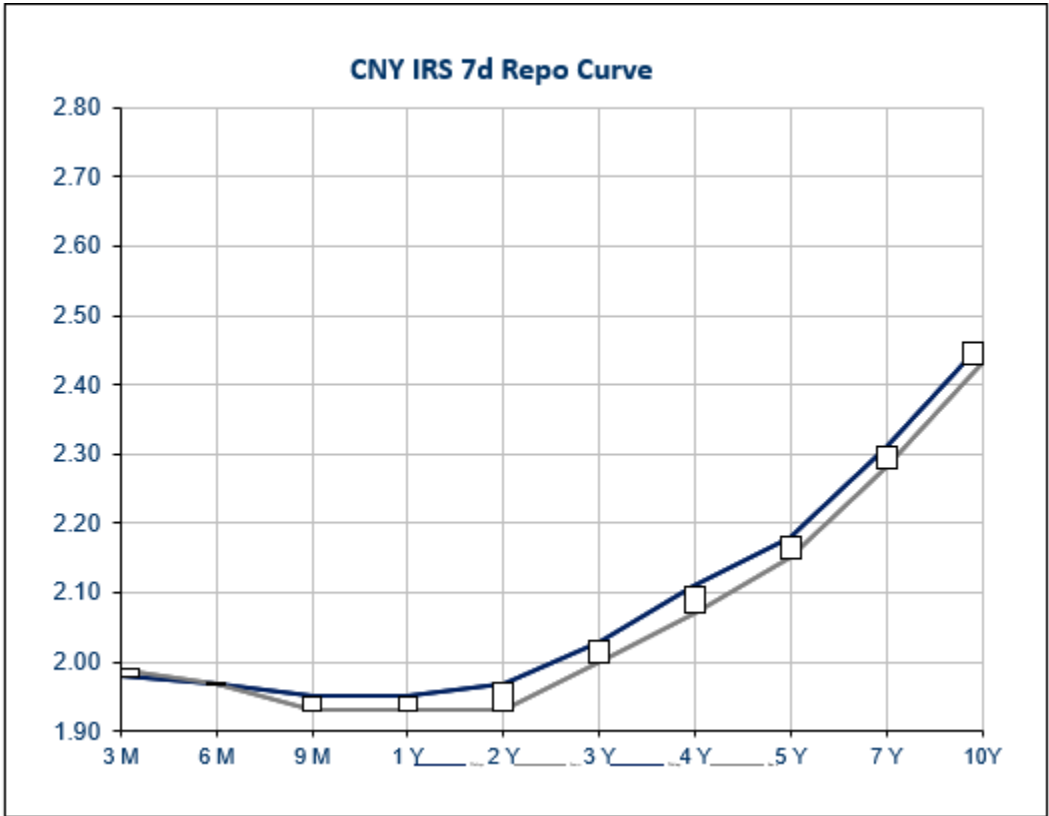
2024/3/1 Friday

Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd											
ONSHORE IRS											
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)		
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.98	-1				3 M	1.74	-			
6 M	1.97	-	6 M	2.16	-	6 M	1.8	-			
9 M	1.95	2	9 M	2.14	3	9 M	1.8	-			
1 Y	1.95	2	1 Y	2.16	3	1 Y	1.9	-		1Y	1.95 2
2 Y	1.97	4	2 Y	2.17	3	2 Y	2	-	2 Y	1.65 -	2Y 1.94 2
3 Y	2.03	3	3 Y	2.25	4	3 Y	2	-	3 Y	1.77 -	3Y 1.99 3
4 Y	2.11	4	4 Y	2.33	4				4 Y	1.8 -	4Y 2.05 4
5 Y	2.18	3	5 Y	2.41	4				5 Y	1.8 -	5Y 2.13 4
7 Y	2.31	3	7 Y	2.52	4				7 Y	1.8 -	
10Y	2.46	3	10Y	2.58	4				10Y	1.8 -	
7D REPO	2.00	-5.00	3M Shibor	2.182	-1.10	O-N Shibor	1.694	5.50	1Y DEPO	1.50	

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-1	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-2	2	-2	3				
9M*1Y	0	-	2	-	6M	19	-	
1*2Y	2	2	1	-	9M	19	1	
1*3Y	8	1	9	1	1Y	21	1	
1*4Y	16	2	17	1	2Y	20	-	
1*5Y	23	1	25	1	3Y	22	-	
2*3Y	6	-1	8	1	4Y	22	-	
2*4Y	14	-	16	1	5Y	23	-	
2*5Y	21	-1	24	1				
3*4Y	8	1	8	-				
3*5Y	15	-	16	-				
4*5Y	7	-1	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	07	24	13	36
今日	07	23	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:
以上所述及所加的所有信息 (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