



【2024-03-19】

 中国央行今日开展 50 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 100 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 50 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 2.1630%，与上一交易日不变。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.15%，后小幅震荡成交在 2.1475%-2.145%，午盘报收 14.75/14.5。中午回来，5y repo 下行成交在 2.145%-2.135%，后反弹上行，报收 15/14.75。1y repo 全天随长端成交在 1.9675%-1.96%，尾盘报收 97/96.75。其他期限，2y repo 成交在 1.9675%-1.965%，3y repo 成交在 2.01%-2.0075%。曲线方面，1x2y repo 成交在 0.5-0.25bp，1x5y repo 成交在 18.25-17.5bp，报收 18/17.5。

 Shibor 端，1y shibor 报收 15.5/15，5y shibor 成交在 2.345%，报收 35/34。基差方面，1y basis 报收 18.75/18，5y basis 报收 20/19.5。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

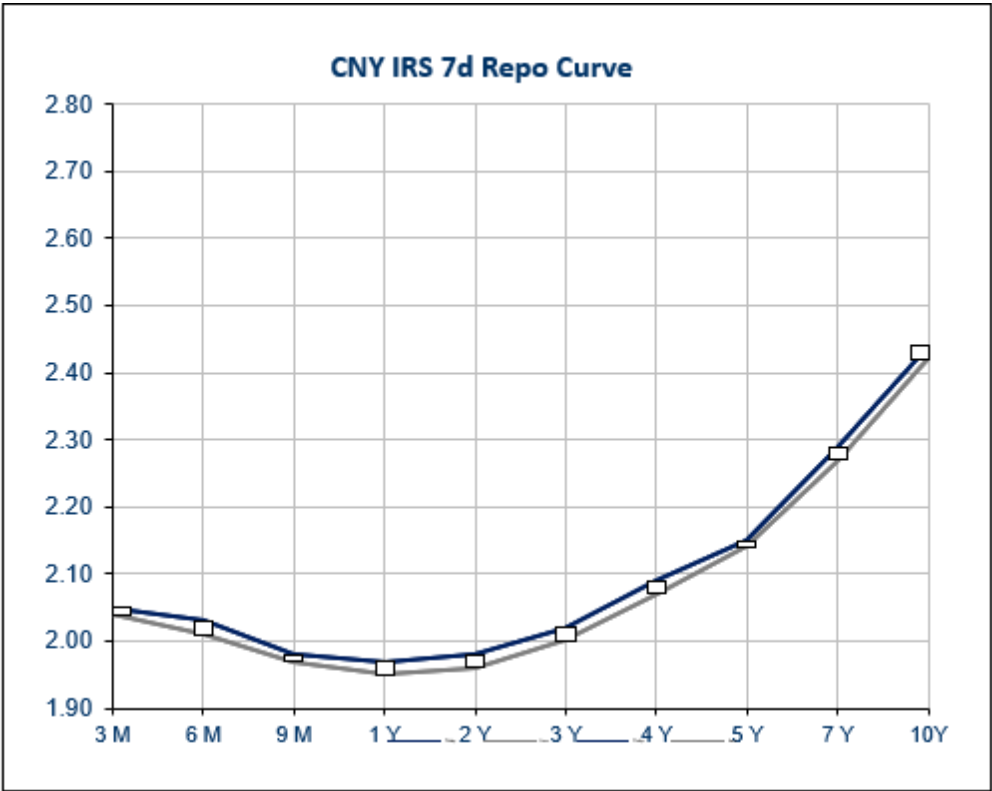
2024/3/19 星期二

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	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.05	1				3 M	1.75	-									
6 M	2.03	2	6 M	2.16	-	6 M	1.75	-									
9 M	1.98	1	9 M	2.13	-	9 M	1.75	-									
1 Y	1.97	2	1 Y	2.16	1	1 Y	1.625	-				1Y	1.96	1			
2 Y	1.98	2	2 Y	2.16	1	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.96	2			
3 Y	2.02	2	3 Y	2.2	2	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	2	3			
4 Y	2.09	2	4 Y	2.27	2				4 Y	1.8	-	4Y	2.06	3			
5 Y	2.15	1	5 Y	2.35	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.13	5			
7 Y	2.29	2	7 Y	2.43	1				7 Y	1.8	-						
10Y	2.44	2	10Y	2.53	1				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.00	-	3M Shibor	2.163	-	O-N Shibor	1.754	0.80	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	-2	1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	-5	-1	-3	-			
9M*1Y	-1	1	3	1	6M	13	-2
1*2Y	1	-	0	-	9M	15	-1
1*3Y	5	-	4	1	1Y	19	-1
1*4Y	12	-	11	1	2Y	18	-
1*5Y	18	-1	19	1	3Y	18	-
2*3Y	4	-	4	1	4Y	18	-
2*4Y	11	-	11	1	5Y	20	-
2*5Y	17	-1	19	1			
3*4Y	7	-	7	-			
3*5Y	13	-1	15	-			
4*5Y	6	-1	8	-			
5*7Y	14	1	8	-1			
5*10Y	29	1	18	-1			

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	6	23	15	35
今日	6	22	14	33



联系人：Ruby Hu
邮箱：vixiong.hu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字接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。其知识产仅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、建议或建议。“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。所有陈述和保证均被明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang