



【2024-03-06】

中国央行今日进行 100 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。今日有 3240 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing: 2.05%，与上一交易日上升 1bp，3m shibor fixing: 2.1650%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.145%附近，后震荡下行成交在 2.1425%-2.1375%区间，午盘报收 14/13.75。中午回来，5y repo 先震荡成交在 2.1375%-2.13%，受降准预期影响，5y repo 快速下行成交在 2.13%-2.10%，报收 10/9.75。1y repo 随长端成交在 1.955%-1.92%，尾盘报收 92.75/92.25。其他期限，2y repo 成交在 1.95%-1.96%，3y repo 成交在 1.9975%-2.005%。曲线方面，3×5y repo 成交在 13.75bp，1×2y repo 成交在 0.5bp，1x5y repo 成交在 19-18bp，报收 18/17.5。

Shibor 端，1y shibor 报收 11/10，5y shibor 成交在 2.355%，报收 31/30。曲线方面，1x5y shibor 成交在 21.5bp，报收 21/19.5，基差方面，1y basis 报收 18.75/17.75，5y basis 报收 20.75/20.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

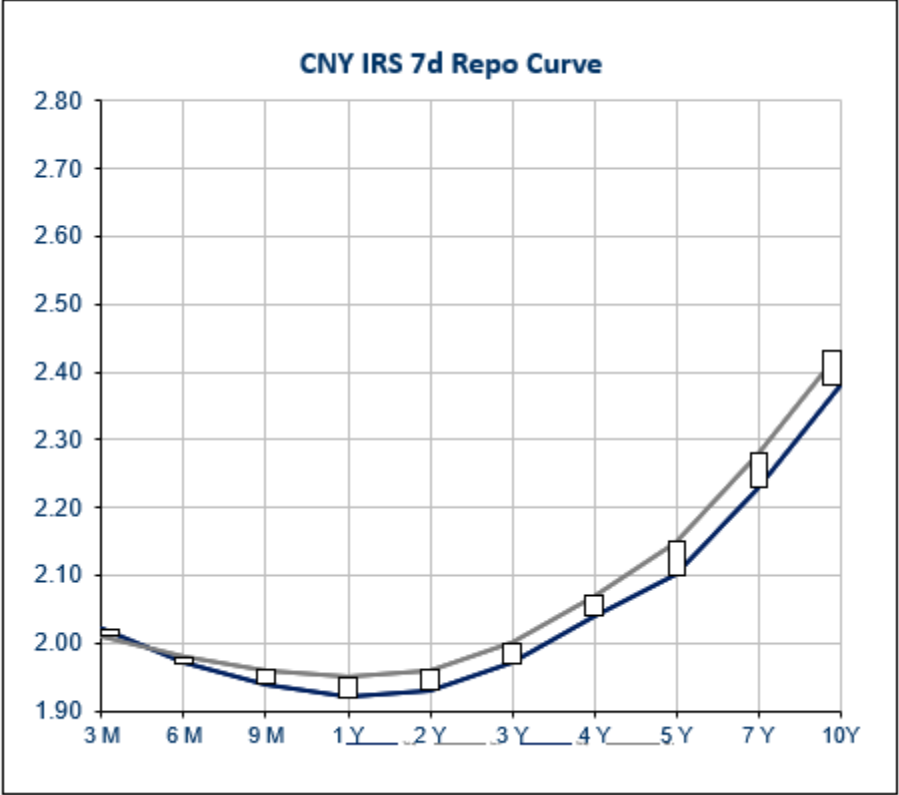
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/3/6 星期三

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
3 M	2.02	1				3 M	1.74	-						
6 M	1.97	-1	6 M	2.1	-4	6 M	1.8	-						
9 M	1.94	-2	9 M	2.07	-5	9 M	1.8	-						
1 Y	1.92	-3	1 Y	2.1	-5	1 Y	1.8	-5				1Y	1.91	-3
2 Y	1.93	-3	2 Y	2.11	-5	2 Y	1.9	-5	2 Y	1.65	-	2Y	1.9	-2
3 Y	1.97	-3	3 Y	2.16	-5	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.93	-3
4 Y	2.04	-3	4 Y	2.23	-6				4 Y	1.8	-	4Y	1.99	-3
5 Y	2.1	-5	5 Y	2.3	-7				5 Y	1.8	-	5Y	2.04	-4
7 Y	2.23	-5	7 Y	2.4	-7				7 Y	1.8	-			
10Y	2.38	-5	10Y	2.46	-7				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.05	1.00	3M Shibor	2.165	-0.20	O-N Shibor	1.713	0.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-5 -2		Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-3 -1	-3 -1				
9M*1Y	-2 -1	3 -	6M	13	-3	
1*2Y	1 -	1 -	9M	13	-3	
1*3Y	5 -	6 -	1Y	18	-2	
1*4Y	12 -	13 -1	2Y	18	-	
1*5Y	18 -2	20 -2	3Y	19	-	
2*3Y	4 -	5 -	4Y	19	-3	
2*4Y	11 -	12 -1	5Y	20	-	
2*5Y	17 -2	19 -2				
3*4Y	7 -	7 -1				
3*5Y	13 -2	14 -2				
4*5Y	6 -2	7 -1				
5*7Y	13 -	10 -				
5*10Y	28 -	16 -				

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	7	22	13	33
今日	6	22	12	32



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: 以上所发及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/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、股票或任何交易策略相关的推介、定价、建议或诱导。“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

文 / Joyce Zhang