



【2024-03-13】

中国央行开展 30 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.8%，与此前持平。当日 100 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing：2.0%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 2.1590%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.1675%附近，后小幅震荡上行，成交在 2.1675%-2.18%区间附近，午盘报收 18/17.75。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 2.185%-2.155%区间附近，报收 16/15.75。1y repo 全天震荡成交在 1.9775%-1.965%区间附近，尾盘报收 96.75/96.5。其他期限，6m repo 成交在 2.005%-2.015%附近，9m repo 成交在 1.9775%-1.985%附近，2y repo 成交在 1.98%-1.97%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-2.75bp 附近，9mx1y repo 成交在-1bp 附近，1x2y repo 成交在 0.5bp 附近，3x4y repo 成交在 07bp 附近，1x5y repo 成交在 20.5-19.5bp 附近，报收 19.5/19.25。

Shibor 端今日成交清淡，9m shibor 成交在 2.14%，1y shibor 报收 16/15，5y shibor 报收 36.5/35.5。基差方面，1y basis 报收 19.25/18.25，5y basis 报收 20.5/19.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

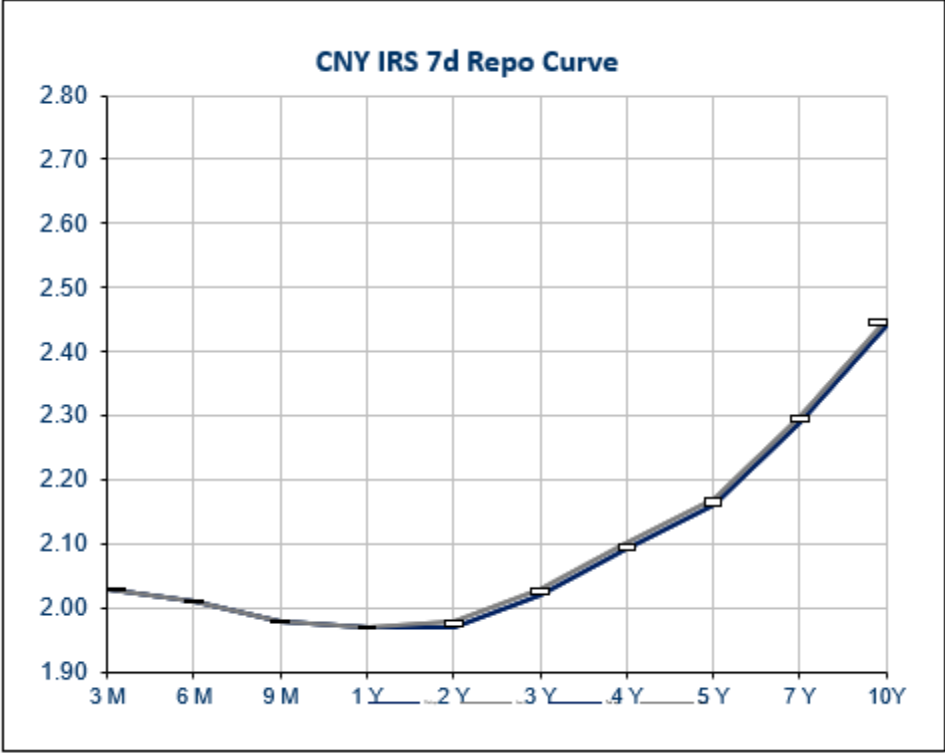
2024/3/13 星期三

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	2.03	-				3 M	1.75	-						
6 M	2.01	-	6 M	2.15	-1	6 M	1.75	-						
9 M	1.98	-	9 M	2.13	-	9 M	1.75	-						
1 Y	1.97	-	1 Y	2.15	-1	1 Y	1.625	-				1Y	1.95	-
2 Y	1.97	-1	2 Y	2.16	-1	2 Y	1.65	-5	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-
3 Y	2.02	-1	3 Y	2.22	-	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.98	-
4 Y	2.09	-1	4 Y	2.29	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.05	-
5 Y	2.16	-1	5 Y	2.36	-2				5 Y	1.8	-	5Y	2.11	-
7 Y	2.29	-1	7 Y	2.46	-2				7 Y	1.8	-			
10Y	2.44	-1	10Y	2.52	-2				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	-	3M Shibor	2.159	0.10	O-N Shibor	1.735	1.40	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-3	-	-2	1				
9M*1Y	-1	-	2	-1	6M	14	-1	
1*2Y	0	-1	1	-	9M	15	-	
1*3Y	5	-1	7	1	1Y	18	-1	
1*4Y	12	-1	14	1	2Y	19	-	
1*5Y	19	-1	21	-1	3Y	20	-	
2*3Y	5	-	6	1	4Y	20	1	
2*4Y	12	-	13	1	5Y	20	-	
2*5Y	19	-	20	-1				
3*4Y	7	-	7	-				
3*5Y	14	-	14	-2				
4*5Y	7	-	7	-2				
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	10	25	17	36
今日	9	25	17	39



联系人: Ruby Wu
邮箱: ruby@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, 并非投资建议/或者有别的意图, 其知识/财产属于上海国脉货币经纪有限公司 (以下简称“上海国脉货币”) 或其三方。“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