



【2024-03-20】

 中国央行今日开展 30 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.8%，与此前持平，因今日有 30 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现零投放零回笼。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 2.16%，与上一交易日下降 0.3bp。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.1525%附近，后震荡上行，成交在 2.15%-2.1675%区间附近，午盘报收 16.75/16.5。中午回来，5y repo 继续震荡上行，成交在 2.1625%-2.18%区间附近，报收 17/16.5。1y repo 全天随长端震荡上行成交在 1.9725%-1.9875%，尾盘报收 98/97.5。其他期限，2y repo 成交在 1.98%-1.9825%区间。曲线方面，1x5y repo 成交在 17.5bp-18bp，报收 19.25/18.75。

 Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 成交在 2.1775%，报收 17.75/17.25，5y shibor 报收 36.75/36。基差方面，1y basis 报收 19.5/19，5y basis 报收 19.75/19.25。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

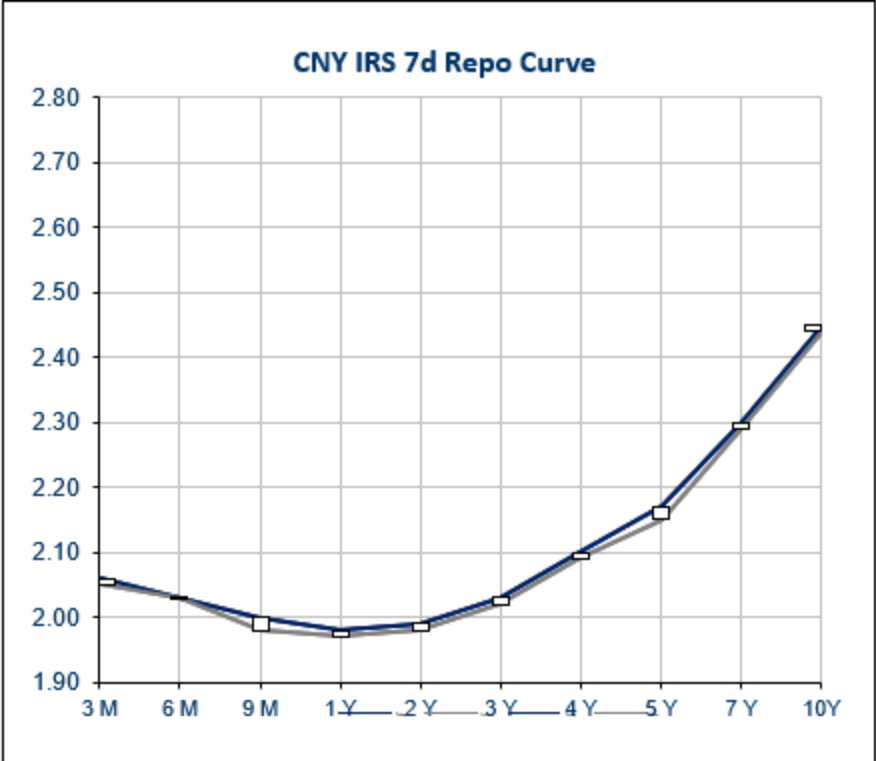
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/3/20 Wednesday

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-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	2.06	1				3 M	1.75	-						
6 M	2.03	-	6 M	2.17	1	6 M	1.75	-						
9 M	2	2	9 M	2.15	2	9 M	1.75	-						
1 Y	1.98	1	1 Y	2.17	1	1 Y	1.675	5				1Y	1.97	1
2 Y	1.99	1	2 Y	2.18	2	2 Y	1.7	5	2 Y	1.65	-	2Y	1.96	-
3 Y	2.03	1	3 Y	2.22	2	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.99	-1
4 Y	2.1	1	4 Y	2.29	2				4 Y	1.8	-	4Y	2.05	-1
5 Y	2.17	2	5 Y	2.37	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.11	-2
7 Y	2.3	1	7 Y	2.45	2				7 Y	1.8	-			
10Y	2.45	1	10Y	2.54	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	-	3M Shibor	2.16	-0.30	0-N Shibor	1.765	1.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	2	-2	1				
9M*1Y	-2	-1	2	-1	6M	14	1	
1*2Y	1	-	1	1	9M	15	-	
1*3Y	5	-	5	1	1Y	19	-	
1*4Y	12	-	12	1	2Y	19	-	
1*5Y	19	1	20	1	3Y	19	-	
2*3Y	4	-	4	-	4Y	19	1	
2*4Y	11	-	11	-	5Y	20	-	
2*5Y	18	1	19	-				
3*4Y	7	-	7	-				
3*5Y	14	1	15	-				
4*5Y	7	1	8	-				
5*7Y	13	-1	8	-				
5*10Y	28	-1	17	-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	22	14	33
今日	6	22	14	33



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiandong.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:
以上所述及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的、或者专用的信息。其知识“仅属于上海国际货币经纪有限责任公司 (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与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、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。所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang