



【2024-03-14】

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 100 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 70 亿元。资金面均衡偏松。7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 2.1610%，与上一交易日上升 0.2bp。
 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.17%，后震荡成交在 2.175%-2.1675%，午盘报收 17.25/17。中午回来，5y repo 继续震荡成交在 2.165%-2.1575%，报收 16.75/16.5。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.9775%-1.9725%，尾盘报收 97.75/97.25。其他期限，2y repo 成交在 1.9825%。曲线方面，9m×1y repo 成交在-1.25bp，1x2y repo 成交在 0.75-0.5bp，1x5y repo 成交在 19.75-19.25bp，报收 19.5/19。
 Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 17/16.5，5y shibor 报收 38.25/37。基差方面，1y basis 报收 19.5/19，5y basis 报收 21.5/20.25。其他方面，报价寥寥，未闻成交。

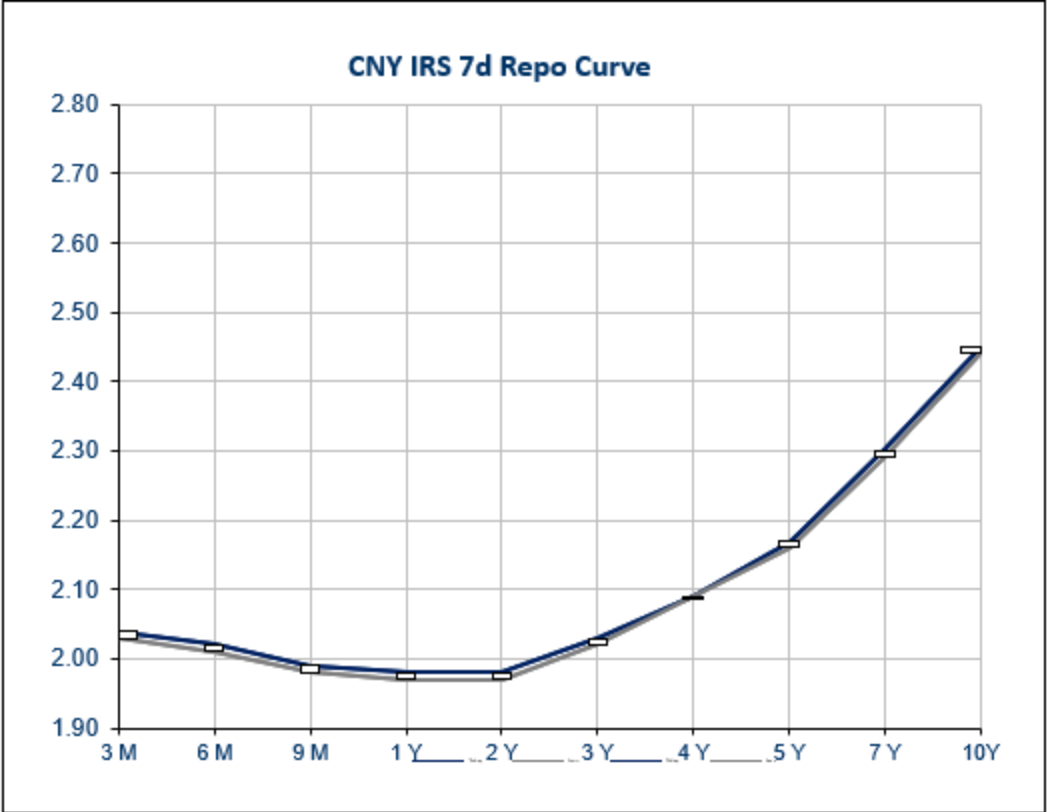
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
 2024/3/14 星期四

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	2.04	1				3 M	1.75	-									
6 M	2.02	1	6 M	2.16	1	6 M	1.75	-									
9 M	1.99	1	9 M	2.15	2	9 M	1.75	-									
1 Y	1.98	1	1 Y	2.17	2	1 Y	1.625	-				1Y	1.96	1			
2 Y	1.98	1	2 Y	2.17	1	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-			
3 Y	2.03	1	3 Y	2.23	1	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.98	-			
4 Y	2.09	-	4 Y	2.3	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.05	-			
5 Y	2.17	1	5 Y	2.38	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.1	-1			
7 Y	2.3	1	7 Y	2.47	1				7 Y	1.8	-						
10Y	2.45	1	10Y	2.53	1				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.00	-	3M Shibor	2.161	0.20	O-N Shibor	1.746	1.10	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	-2	-			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	-3	-	-1	1			
9M*1Y	-1	-	2	-	6M	14	-
1*2Y	0	-	0	-1	9M	16	1
1*3Y	5	-	6	-1	1Y	19	1
1*4Y	11	-1	13	-1	2Y	19	-
1*5Y	19	-	21	-	3Y	20	-
2*3Y	5	-	6	-	4Y	21	1
2*4Y	11	-1	13	-	5Y	21	-
2*5Y	19	-	21	1			
3*4Y	6	-1	7	-			
3*5Y	14	-	15	1			
4*5Y	8	1	8	1			
5*7Y	13	-	9	-1			
5*10Y	28	-	15	-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	9	25	17	39
今日	9	26	19	38



联系人: Ruby Hu
邮箱: viaoting.hu@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责任公司 (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