



【2024-03-18】

 中国人民银行今日进行 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 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: 2.1630%，与上一交易日不变。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.1625%附近，后小幅震荡下行，成交在 2.1675%-2.155%区间附近，午盘报收 15.75/15.5。中午回来，5y repo 继续震荡下行，成交在 2.1575%-2.1425%区间附近，报收 14.75/14.25。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.9725%-1.9575%区间附近，尾盘报收 96/95.75。其他期限，2y repo 成交在 1.98%-1.9625%附近, 3y repo 成交在 2.02%-2.015%附近。曲线方面，1x2y repo 成交在 0.5bp 附近，1x5y repo 成交在 18.75/18.5bp 附近，报收 18.75/18.5。

 Shibor 端，1y shibor 成交在 2.1575%附近，报收 15.5/14.5，3y shibor 成交在 2.20%附近，4y shibor 成交在 2.27%附近，5y shibor 报收 34.25/33.25。基差方面，4y basis 成交在 18.5bp 附近，1y basis 报收 19.5/19，5y basis 报收 20/19.25。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

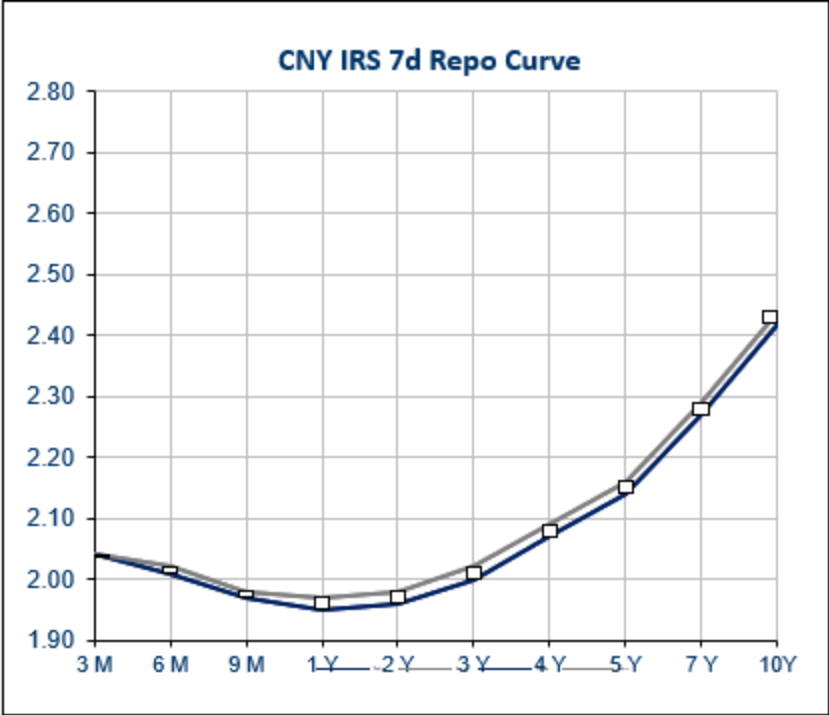
2024/3/18 星期一

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	-				3 M	1.75	-						
6 M	2.01	-1	6 M	2.16	-	6 M	1.75	-						
9 M	1.97	-1	9 M	2.13	-2	9 M	1.75	-						
1 Y	1.95	-2	1 Y	2.15	-2	1 Y	1.625	-				1Y	1.95	-1
2 Y	1.96	-2	2 Y	2.15	-3	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-
3 Y	2	-2	3 Y	2.18	-4	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.97	-1
4 Y	2.07	-2	4 Y	2.25	-5				4 Y	1.8	-	4Y	2.03	-2
5 Y	2.14	-2	5 Y	2.33	-4				5 Y	1.8	-	5Y	2.08	-2
7 Y	2.27	-2	7 Y	2.42	-4				7 Y	1.8	-			
10Y	2.42	-2	10Y	2.52	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	-	3M Shibor	2.163	-	O-N Shibor	1.746	-2.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-4	-	-3	-2				
9M*1Y	-2	-1	2	-	6M	15	1	
1*2Y	1	-	0	-1	9M	16	-1	
1*3Y	5	-	3	-2	1Y	20	-	
1*4Y	12	-	10	-3	2Y	19	-	
1*5Y	19	-	18	-2	3Y	18	-	
2*3Y	4	-	3	-1	4Y	18	-3	
2*4Y	11	-	10	-2	5Y	19	-	
2*5Y	18	-	18	-1				
3*4Y	7	-	7	-1				
3*5Y	14	-	15	-				
4*5Y	7	-	8	1				
5*7Y	13	-	9	-				
5*10Y	28	-	19	4				

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	8	24	17	36
今日	6	23	15	35



联系人: Ruby Hu
邮箱: ruby.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:
以上所发及附发的所有信息 (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”) 或其三方, “信息”不应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, 也不保证其准确性、及时性或完整性等要求, 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