



【2024-03-05】

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 3840 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing：2.04%，与上一交易日上升 4bp，3m shibor fixing: 2.1670%，与上一交易日下降 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.1675%附近，后震荡下行，成交在 2.1675%-2.1525%区间附近，后回调成交到 2.1675%附近，午盘报收 16.25/16。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.1525%-2.1625%区间附近，尾盘稍微下行，成交到 2.1475%附近，报收 15/14.75。1y repo 全天震荡成交在 1.9475%-1.96%区间附近，尾盘报收 95.25/95。其他期限，1m repo 成交在 2.025%-2.03%附近，3m repo 成交在 2.015%-2.02%附近，2y repo 成交在 1.9575%-1.965%附近，3y repo 成交在 2.0125%附近。曲线方面，1mx3m 成交在-1--01.5bp 附近，2x5y repo 成交在 20-20.25bp 附近，1x5y repo 成交在 21-20bp 附近，报收 20/19.75。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.1525%-2.16%附近，报收 15.75/15.25，2y shibor 成交在 2.1675%-2.175%附近，5y shibor 成交在 2.375%-2.38%附近，报收 37.5/37。曲线方面，1x2y shibor 成交在 1.5-2bp 附近，2x5y shibor 成交在 21bp 附近，基差方面，1y basis 成交在 20-20.5bp 附近，报收 20.25/19.5，5y basis 成交在 22bp 附近，报收 22/21.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

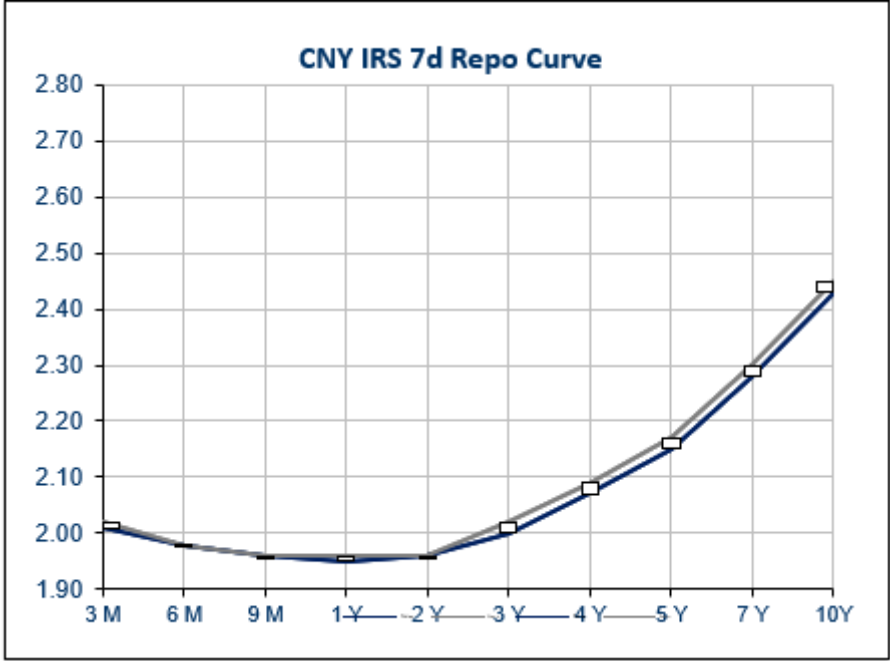
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/3/5 星期二

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	2.01	-1				3 M	1.74	-						
6 M	1.98	-	6 M	2.14	-1	6 M	1.8	-						
9 M	1.96	-	9 M	2.12	-1	9 M	1.8	-						
1 Y	1.95	-1	1 Y	2.15	-1	1 Y	1.85	-5				1Y	1.94	-1
2 Y	1.96	-	2 Y	2.16	-1	2 Y	1.95	-5	2 Y	1.65	-	2Y	1.92	-2
3 Y	2	-2	3 Y	2.21	-2	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.96	-2
4 Y	2.07	-2	4 Y	2.29	-3				4 Y	1.8	-	4Y	2.02	-2
5 Y	2.15	-2	5 Y	2.37	-2				5 Y	1.8	-	5Y	2.08	-3
7 Y	2.28	-2	7 Y	2.47	-3				7 Y	1.8	-			
10Y	2.43	-2	10Y	2.53	-3				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.04	4.00	3M Shibor	2.167	-0.40	O-N Shibor	1.711	-	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
					Tenor	Mid	Δbp
3M*6M	-3	1					
6M*9M	-2	-	-2	-			
9M*1Y	-1	-1	3	-	6M	16	-1
1*2Y	1	1	1	-	9M	16	-1
1*3Y	5	-1	6	-1	1Y	20	-
1*4Y	12	-1	14	-2	2Y	20	-
1*5Y	20	-1	22	-1	3Y	21	-
2*3Y	4	-2	5	-1	4Y	22	-1
2*4Y	11	-2	13	-2	5Y	22	-
2*5Y	19	-2	21	-1			
3*4Y	7	-	8	-1			
3*5Y	15	-	16	-			
4*5Y	8	-	8	1			
5*7Y	13	-	10	-1			
5*10Y	28	-	16	-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	08	23	14	36
今日	7	22	13	33



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiaoting.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:
以上所登及刊发的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的私/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、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, 所有前述和保证均按照免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang

禁止处理涉密信息和内部敏感信息
禁止处理涉密信息和内部敏感信息