



【2024-03-07】

中国央行今日开展 100 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。因今日有 1170 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1070 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing：2.00%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 2.1640%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.0875%附近，后一路上行成交在 2.0875%-2.1325%区间，午盘报收 13.5/13。中午回来，5y repo 震荡回落成交在 2.1275%-2.1175%，尾盘报收 12.75/12.5。1y repo 随长端成交在 1.9225%-1.94%，尾盘报收 94/93.75。其他期限，2y repo 成交在 1.935%-1.94%，3y repo 成交在 1.985%。曲线方面，3×5y repo 成交在 14bp，1x5y repo 成交在 19-18.5bp，报收 18.7/18.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.12%附近，报收 14/13，5y shibor 报收 34.25/33.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 21/20.25，基差方面，1y basis 成交 19bp,报收 20/19.5，5y basis 报收 21.25/20.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

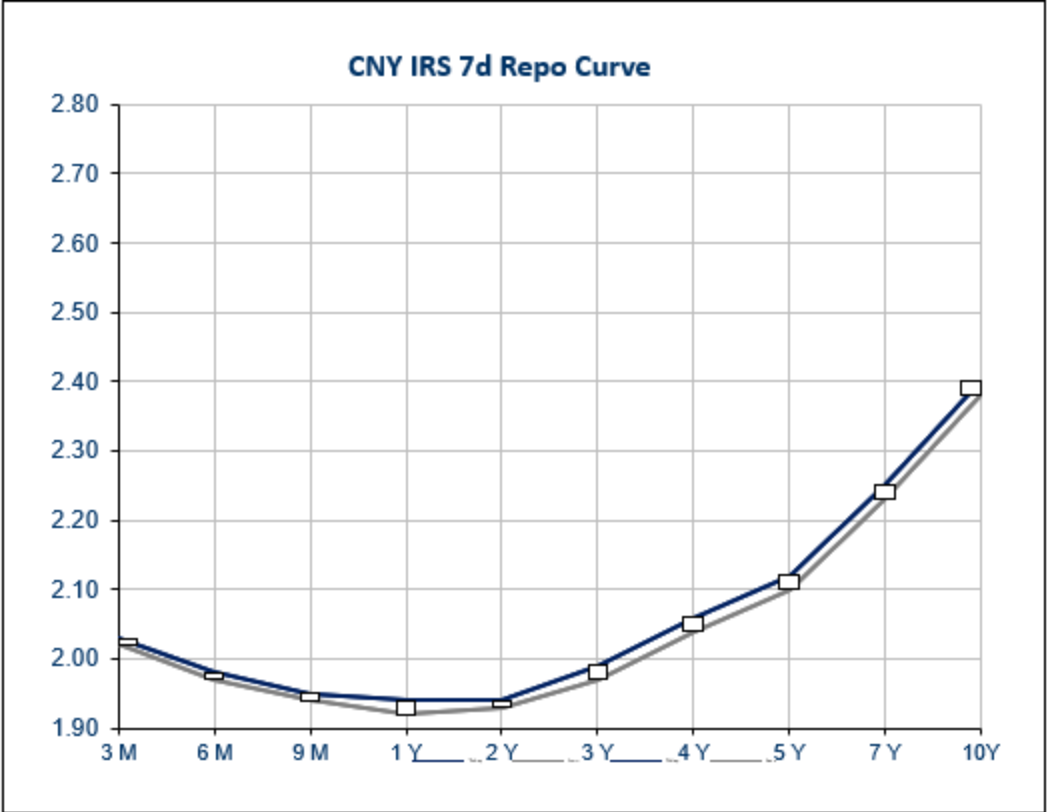
2024/3/7 星期四

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	2.03	1				3 M	1.75	1						
6 M	1.98	1	6 M	2.13	3	6 M	1.75	-5						
9 M	1.95	1	9 M	2.11	4	9 M	1.75	-5						
1 Y	1.94	2	1 Y	2.13	3	1 Y	1.75	-5				1Y	1.94	3
2 Y	1.94	1	2 Y	2.14	3	2 Y	1.85	-5	2 Y	1.65	-	2Y	1.92	2
3 Y	1.99	2	3 Y	2.19	3	3 Y	1.95	-5	3 Y	1.77	-	3Y	1.95	2
4 Y	2.06	2	4 Y	2.26	3				4 Y	1.8	-	4Y	2.02	3
5 Y	2.12	2	5 Y	2.34	4				5 Y	1.8	-	5Y	2.07	3
7 Y	2.25	2	7 Y	2.44	4				7 Y	1.8	-			
10Y	2.4	2	10Y	2.5	4				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	-5.00	3M Shibor	2.164	-0.10	O-N Shibor	1.713	-	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-5	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-3	-	-2	1				
9M*1Y	-1	1	2	-1	6M	15	2	
1*2Y	0	-1	1	-	9M	16	3	
1*3Y	5	-	6	-	1Y	19	1	
1*4Y	12	-	13	-	2Y	20	-	
1*5Y	18	-	21	1	3Y	20	-	
2*3Y	5	1	5	-	4Y	20	1	
2*4Y	12	1	12	-	5Y	22	-	
2*5Y	18	1	20	1				
3*4Y	7	-	7	-				
3*5Y	13	-	15	1				
4*5Y	6	-	8	1				
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	6	22	12	32
今日	6	21	13	31



联系人: Ruby Wu
邮箱: viaoting.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:
以上所发及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 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

文 / Joyce Zhang