



【2024-03-11】

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%，因今日有 100 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现零回笼零投放。资金面均衡偏松。7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 2.159%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.13%附近，后震荡成交在 2.1325%-2.14%，午盘报收 14.25/13.75。中午回来，5y repo 震荡上行，成交在 2.14%-2.1525%，报收 15.25/14.75。1y repo 全天随长端成交在 1.95%-1.955%，尾盘报收 96/95.5。其他期限，2y repo 成交在 1.9625%，3y repo 成交在 2.025%。曲线方面，3×5y repo 成交在 13bp，1x5y repo 成交在 18.5-19.25bp，报收 19.5/19。

Shibor 端，1y shibor 报收 15/14.5，5y shibor 成交在 2.3375%-2.35%，报收 35.5/34.75。基差方面，1y basis 报收 19.5/18.75，5y basis 成交在 19.75bp-20bp，报收 20.25/20。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

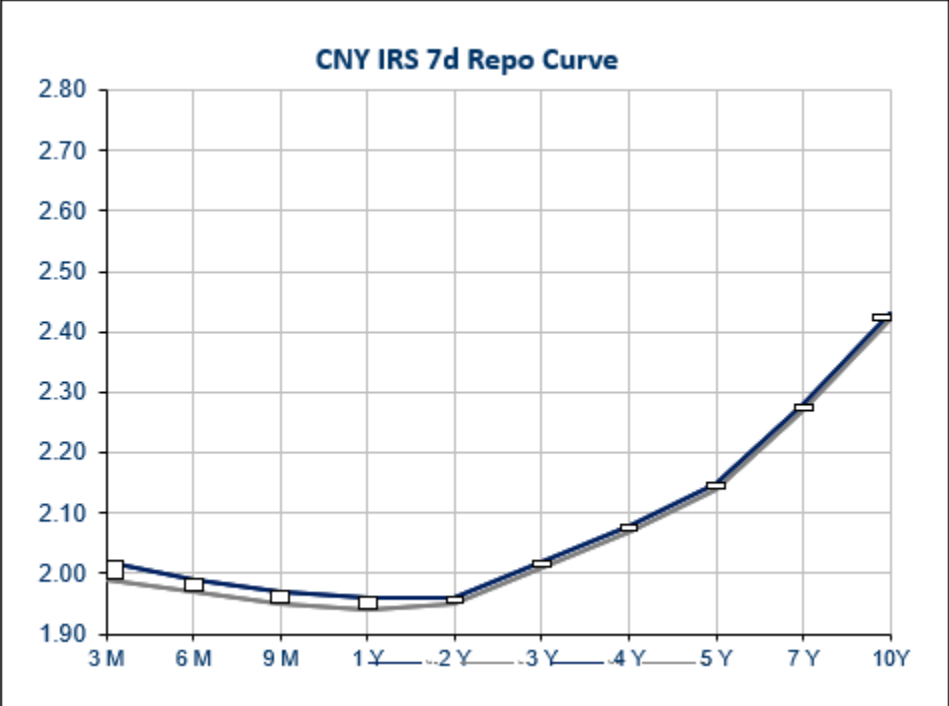
2024/3/11 星期一

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	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.02	3				3 M	1.75	-									
6 M	1.99	2	6 M	2.15	1	6 M	1.75	-									
9 M	1.97	2	9 M	2.13	2	9 M	1.75	-									
1 Y	1.96	2	1 Y	2.15	1	1 Y	1.65	-5				1Y	1.94	1			
2 Y	1.96	1	2 Y	2.16	1	2 Y	1.75	-5	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	1			
3 Y	2.02	1	3 Y	2.2	-	3 Y	1.85	-5	3 Y	1.77	-	3Y	1.97	1			
4 Y	2.08	1	4 Y	2.27	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.03	1			
5 Y	2.15	1	5 Y	2.35	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.09	2			
7 Y	2.28	1	7 Y	2.45	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.43	1	10Y	2.51	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.00	-	3M Shibor	2.159	-0.10	O-N Shibor	1.731	1.10	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-1		Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-2	-	-2	1			
9M*1Y	-1	-	2	-1	6M	16	-1
1*2Y	0	-1	1	-	9M	16	-
1*3Y	6	-1	5	-1	1Y	19	-1
1*4Y	12	-1	12	-1	2Y	20	-
1*5Y	19	-1	20	-1	3Y	18	-
2*3Y	6	-	4	-1	4Y	19	-1
2*4Y	12	-	11	-1	5Y	20	-
2*5Y	19	-	19	-1			
3*4Y	6	-	7	-			
3*5Y	13	-	15	-			
4*5Y	7	-	8	-			
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	21	12	31
今日	8	23	14	33



联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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:
以上所述及附带的任何信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或者有别的意图, 其知识产仅属于上海国脉货币经纪有限公司 (以下简称“上海国脉货币”) 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说免责声明声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN