



【2024-03-04】

中国央行今日开展 100 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 3290 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 3190 亿元。7d repo fixing：2.00%，与上一交易日持平，3m shibor fixing: 2.1710%，与上一交易日下降 1.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘开盘成交在 2.17%而后震荡下行，成交在 2.1675%-2.1575%，午盘报收 16.75/16.5。午后 5y repo 小幅下行成交在 2.1675%-2.16%，尾盘回升至 2.17%附近，报收 17/16.5。1y repo 震荡上行成交在 1.935%-1.9575% 尾盘报收 95.75/95.5。其他期限，9m repo 成交在 2.9525%-2.955%附近，3y repo 成交在 2.01%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在-2.25 bp 附近，1x5y repo 成交在 22bp-20.75bp 附近，报收 21.5/21。

Shibor 端，1y shibor 报收 16.25/16，5y shibor 成交在 2.3825%-2.385%附近，报收 39.5/38.5。其他期限，9m shibor 成交在 2.13%附近。曲线方面。1×5y shibor 报收 23.75/22.75。基差方面，9m basis 成交在 17.75-17bp 附近。1y basis 成交在 20.75bp 附近，报收 20.75/20.5。5y basis 成交在 22bp 附近，报收 22.75/22.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

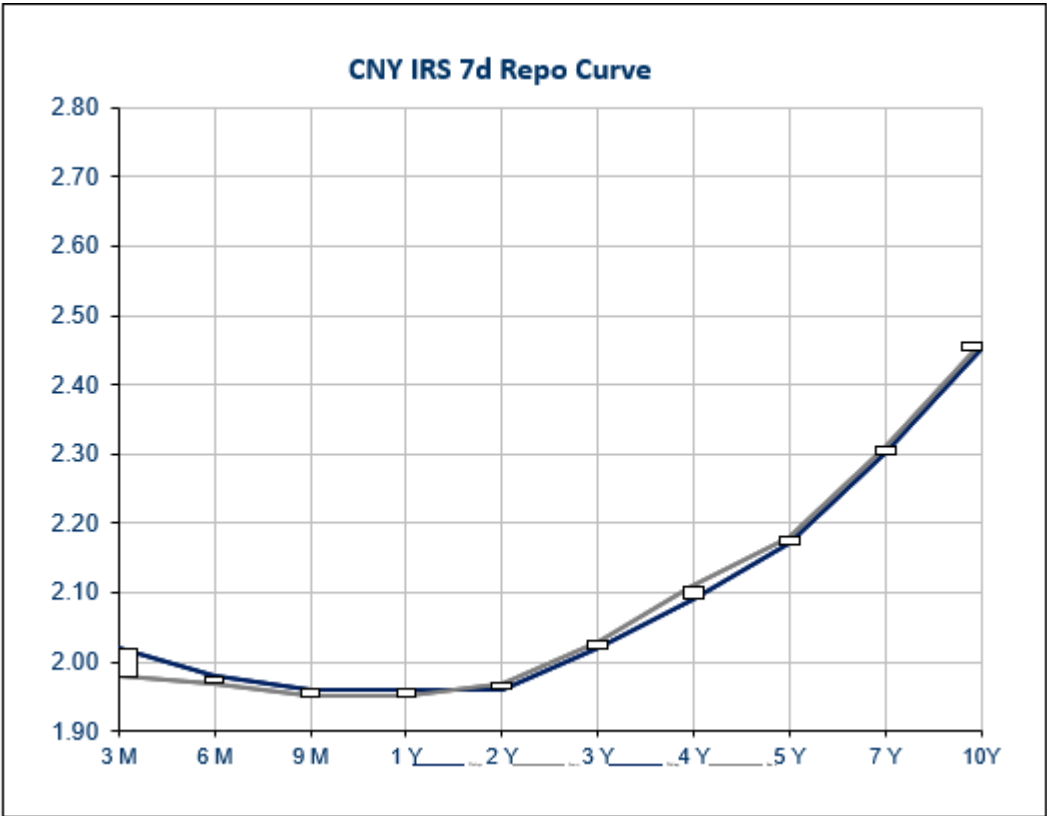
2024/3/4 Monday

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	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp			
3 M	2.02	4				3 M	1.74	-									
6 M	1.98	1	6 M	2.15	-1	6 M	1.8	-									
9 M	1.96	1	9 M	2.13	-1	9 M	1.8	-									
1 Y	1.96	1	1 Y	2.16	-	1 Y	1.9	-				1Y	1.95	-			
2 Y	1.96	-1	2 Y	2.17	-	2 Y	2	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-			
3 Y	2.02	-1	3 Y	2.23	-2	3 Y	2	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.98	-1			
4 Y	2.09	-2	4 Y	2.32	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.04	-1			
5 Y	2.17	-1	5 Y	2.39	-2				5 Y	1.8	-	5Y	2.11	-2			
7 Y	2.3	-1	7 Y	2.5	-2				7 Y	1.8	-						
10Y	2.45	-1	10Y	2.56	-2				10Y	1.8	-						
7D REPO	2.00	-	3M Shibor	2.171	-1.10	O-N Shibor	1.711	1.70	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	-4	-3			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	-2	-	-2	-			
9M*1Y	0	-	3	1	6M	17	-2
1*2Y	0	-2	1	-	9M	17	-2
1*3Y	6	-2	7	-2	1Y	20	-1
1*4Y	13	-3	16	-1	2Y	21	-
1*5Y	21	-2	23	-2	3Y	21	-
2*3Y	6	-	6	-2	4Y	23	1
2*4Y	13	-1	15	-1	5Y	22	-
2*5Y	21	-	22	-2			
3*4Y	7	-1	9	1			
3*5Y	15	-	16	-			
4*5Y	8	1	7	-1			
5*7Y	13	-	11	-			
5*10Y	28	-	17	-			

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	07	23	13	36
今日	08	23	14	36



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

文 / Joyce Zhang