



【2024-04-08】

中国央行今日开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率持平 1.8%，与此前持平，因今日有 20 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现零投放零回笼。资金面整体偏松，7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日上升 15bp，3m shibor fixing:2.1330%，与上一交易日下降 0.8 个 bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.135%附近，上午荡成交在 2.1325%-2.14%区间附近，午盘报收 13.75/13.5。中午回来，5y repo 低开在 2.125%，之后震荡回升，成交在 2.1225%-2.1375%附近，报收 13.5/13.25。1y repo，震荡成交在 1.955%-1.965%区间附近，尾盘报收 96/95.75。其他期限，9m repo 成交在 1.9775%-1.98%附近，2y repo 成交在 1.9625%-1.965%附近，4y repo 成交在 2.065%-2.0675%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-2bp，1x2 repo 成交在 par，4x5 repo 成交在 06bp 附近。1x5 repo 成交在 17.75bp 附近，报收 18/17.5。

Shibor 端，1y shibor 成交 2.12%附近，报收 12.5/11.5，5y shibor 成交在 2.305%-2.3125%附近，报收 30.75/30。其他期限，6m shibor 成交 2.11%附近。基差方面，1y basis 报收 16.75/16，5y basis 成交在 17.5-17.25bp 附近，报收 17/16.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

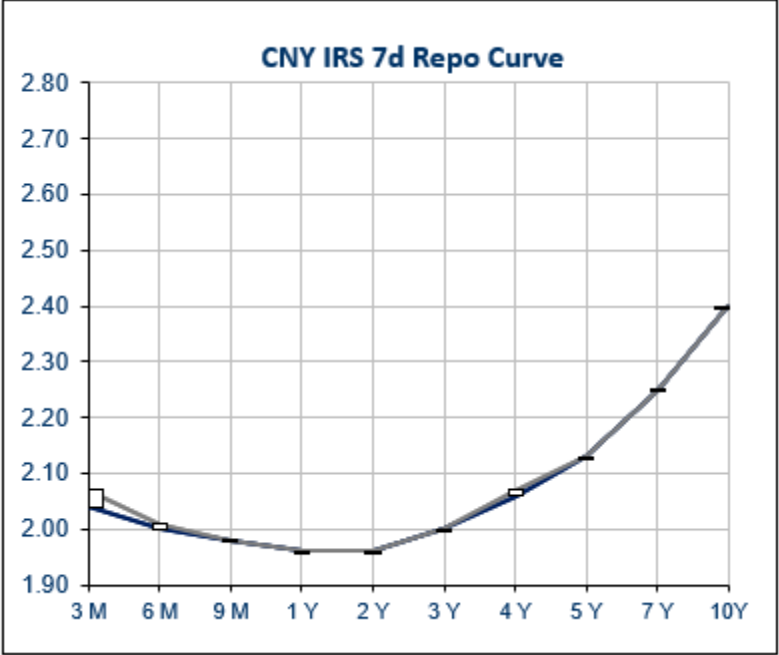
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/4/8 Monday

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/0-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	2.04	-3				3 M	1.75	3						
6 M	2	-1	6 M	2.12	-2	6 M	1.75	-						
9 M	1.98	-	9 M	2.1	-1	9 M	1.75	-						
1 Y	1.96	-	1 Y	2.12	-1	1 Y	1.63	-				1Y	1.96	-
2 Y	1.96	-	2 Y	2.13	-	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-
3 Y	2	-	3 Y	2.17	1	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.97	-
4 Y	2.06	-1	4 Y	2.24	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.03	-
5 Y	2.13	-	5 Y	2.3	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.08	-
7 Y	2.25	-	7 Y	2.43	1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.4	-	10Y	2.52	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	15	3M Shibor	2.133	-0.8	0-N Shibor	1.711	0.3	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-4	2			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-2	1	-2	1				
9M*1Y	-2	-	2	-	6M	12	-1	
1*2Y	0	-	1	1	9M	12	-1	
1*3Y	4	-	5	2	1Y	16	-1	
1*4Y	10	-1	12	2	2Y	17	-	
1*5Y	17	-	18	-	3Y	17	1	
2*3Y	4	-	4	1	4Y	18	-	
2*4Y	10	-1	11	1	5Y	17	-1	
2*5Y	17	-	17	-1				
3*4Y	6	-1	7	-				
3*5Y	13	-	13	-2				
4*5Y	7	1	6	-2				
5*7Y	12	-	13	2				
5*10Y	27	-	22	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	45	44	41	40	37	36	37
今日	45	44	41	40	37	36	37

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	5	24	11	35
今日	3	24	9	34



联系人: Ruby Wu
邮箱: ruby@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:
以上所述及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 并非投资建议, 或者任何的信息, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限责任公司 (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、股票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。所有陈述和保证均按初始披露声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang