



【2024-04-01】

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%。今日有 500 亿元 7 天期逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing：2.05%，与上一交易日下降 25bp，3m shibor fixing: 2.1570%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.15%附近，后震荡成交在 2.15%-2.16%区间附近，午盘报收 15.25/15。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.15%-2.1575%区间附近，报收 15.25/15。1y repo 全天震荡成交在 1.9575%-1.97%区间附近，尾盘报收 96.5/96.25。其他期限，2y repo 成交在 1.96%-1.9625%附近。曲线方面，1x2y repo 成交在-0.25bp 附近，1x5y repo 成交在 19-18.75bp 附近，报收 19/18.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 14.5/14.25，5y shibor 报收 34/33。基差方面，1y basis 报收 18.25/18，5y basis 报收 18.75/18。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

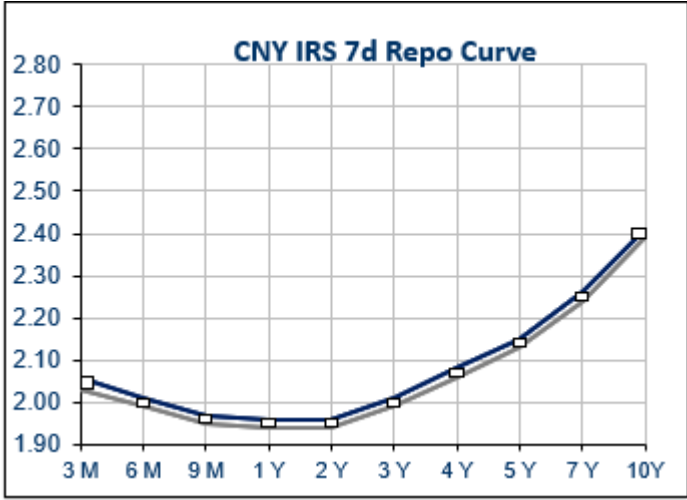
2024/4/1 Monday

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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.06	3				3 M	1.75	-						
6 M	2.01	2	6 M	2.15	1	6 M	1.75	-						
9 M	1.97	2	9 M	2.12	1	9 M	1.75	-						
1 Y	1.96	2	1 Y	2.14	1	1 Y	1.62	-				1Y	1.96	2
2 Y	1.96	2	2 Y	2.15	2	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.95	3
3 Y	2.01	2	3 Y	2.19	2	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.98	2
4 Y	2.08	2	4 Y	2.26	2				4 Y	1.8	-	4Y	2.04	2
5 Y	2.15	2	5 Y	2.34	3				5 Y	1.8	-	5Y	2.1	2
7 Y	2.26	2	7 Y	2.43	1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.41	2	10Y	2.51	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.05	-25.00	3M Shibor	2.157	0.10	0-N Shibor	1.728	1	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	-5	-1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	-4	-	-3	-			
9M*1Y	-1	-	2	-	6M	14	-1
1*2Y	0	-	1	1	9M	15	-1
1*3Y	5	-	5	1	1Y	18	-1
1*4Y	12	-	12	1	2Y	19	-
1*5Y	19	-	20	2	3Y	18	-
2*3Y	5	-	4	-	4Y	18	-
2*4Y	12	-	11	-	5Y	19	1
2*5Y	19	-	19	1			
3*4Y	7	-	7	-			
3*5Y	14	-	15	1			
4*5Y	7	-	8	1			
5*7Y	11	-	9	-2			
5*10Y	26	-	17	-3			

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	230022/5y	230018/5y	230208/5y	230215/5y
Swap	repo	repo	repo	repo
昨日	6	25	12	36
今日	6	25	12	35



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:

以上所登及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 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