

# 收盘日评 银行间利率衍生品市场

常规报告系列



**【2024-04-24】**

中国人民银行今日开展 20 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 20 亿元 7 天期逆回购到期，当日逆回购实现零投放零回笼。资金面整体均衡，7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日持平，3m shibor fixing: 2.0140%，与上一交易日下降 0.4 个 bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.085%附近，后震荡成交在 2.08%-2.09%区间附近，午盘报收 08.75/08.25。中午回来，5y repo 上行成交在 2.09%-2.1075%附近，报收 10.75/10.5。1y repo 随长端震荡成交在 1.92%-1.9375%区间附近，尾盘报收 93.75/93.5。其他期限，9m repo 成交在 1.935%附近，2y repo 成交在 1.925%-1.9375%附近。曲线方面，9mx5y repo 成交在 14.75bp 附近，1x5y repo 报收 17/16.75。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.0125%-2.02%区间附近，报收 02.75/02。5y shibor 成交在 2.225%-2.23%附近，报收 23/22.75。其他期限，2y shibor 成交 2.02%附近。曲线方面，1x2 shibor 成交在 0.5-0.75bp，1x5 shibor 成交 20.5bp 附近，报收 20.75/20。基差方面，1y basis 报收 09/08.25，5y basis 报收 12.5/12。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

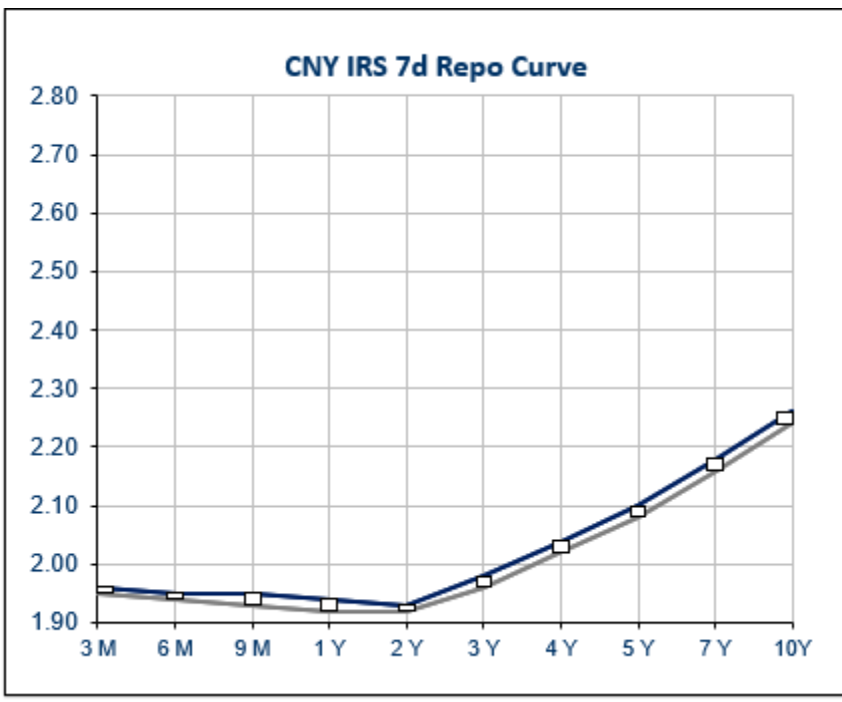
2024/4/24 Wednesday

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	1.96	1				3 M	1.75	-						
6 M	1.95	1	6 M	2	1	6 M	1.7	-						
9 M	1.95	2	9 M	2.02	2	9 M	1.75	-						
1 Y	1.94	2	1 Y	2.02	2	1 Y	1.75	5				1Y	1.93	1
2 Y	1.93	1	2 Y	2.03	2	2 Y	1.75	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	3
3 Y	1.98	2	3 Y	2.08	2	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.95	2
4 Y	2.04	2	4 Y	2.15	2				4 Y	1.8	-	4Y	2.02	2
5 Y	2.1	2	5 Y	2.23	4				5 Y	1.8	-	5Y	2.05	3
7 Y	2.18	2	7 Y	2.31	2				7 Y	1.8	-			
10Y	2.26	2	10Y	2.38	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-	3M Shibor	2.014	-0.40	0-N Shibor	1.784	-0.40	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS			SHIBOR-REPO		
			Tenor	Mid	Δ bp			
3M*6M	-1	-						
6M*9M	0	1						
9M*1Y	-1	-	6M	5	-			
1*2Y	-1	-1	9M	7	-			
1*3Y	4	-	1Y	8	-			
1*4Y	10	-	2Y	10	1			
1*5Y	16	-	3Y	10	-			
2*3Y	5	1	4Y	18	-			
2*4Y	11	1	5Y	13	2			
2*5Y	17	1						
3*4Y	6	-						
3*5Y	12	-						
4*5Y	6	-						
5*7Y	8	-						
5*10Y	16	-						

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	47	45	42	39	38	37	38
今日	47	45	43	39	35	34	34

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-2	20	2	26
今日	0	23	4	30



联系人: Ruby Wu  
 邮箱: [rubywu@cfets-nex.com.cn](mailto: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:  
 以上所述及列出的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识仅限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任何投资建议、  
 投资建议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明确免责声明。

[WWW.CFETS-NEX.COM.CN](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)

文 / Joyce Zhang