



【2024-04-11】

中国央行今日进行 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，与此前持平。今日无逆回购到期。资金面整体均衡，7d repo fixing：1.92%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing:2.1050%，与上一交易日下降 1.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.125%附近，小幅震荡成交在 2.1175%-2.1275%区间附近，午盘报收 12.75/12.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.1325%-2.1225%区间附近，报收 12/11.75。1y repo，震荡成交在 1.9275%-1.9375%区间附近，尾盘报收 93.5/93。其他期限，6m repo 成交在 1.955%-1.9575%附近，9m repo 成交在 1.9475%附近。曲线方面，2yx5y repo 成交在 18.5bp 附近，6mx9mx1y repo 成交在 0.25bp 附近，1x5y repo 成交在 19bp-19.25bp 区间附近，报收 19.25/19。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.09%-2.0825%附近，报收 08.5/08.25，5y shibor 报收 29.75/28.75。基差方面，1y basis 成交在 15bp 附近，报收 15.25/14.75，5y basis 报收 17.5/17。

LPR 端，1y LPR_1y 成交在 3.43%，3.42%点位，2y LPR_1y 成交在 3.395%点位。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

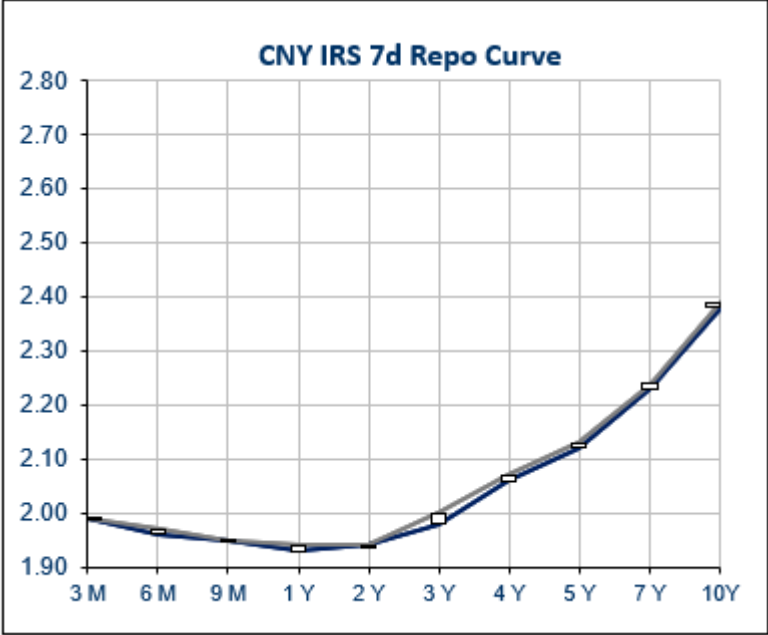
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/4/11 Thursday

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	1.99	-				3 M	1.7	-5									
6 M	1.96	-1	6 M	2.08	-2	6 M	1.7	-5									
9 M	1.95	-	9 M	2.07	-1	9 M	1.7	-5									
1 Y	1.93	-1	1 Y	2.08	-2	1 Y	1.63	-				1Y	1.93	-1			
2 Y	1.94	-	2 Y	2.1	-	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	-			
3 Y	1.98	-2	3 Y	2.15	-1	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.96	-			
4 Y	2.06	-1	4 Y	2.22	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.02	-			
5 Y	2.12	-1	5 Y	2.29	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.08	1			
7 Y	2.23	-1	7 Y	2.4	2				7 Y	1.8	-						
10Y	2.38	-1	10Y	2.47	1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.92	2.00	3M Shibor	2.105	-1.20	0-N Shibor	1.721	-0.10	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-1	1	-1	1				
9M*1Y	-2	-1	1	-1	6M	12	-1	
1*2Y	1	1	2	2	9M	12	-1	
1*3Y	5	-1	7	1	1Y	15	-1	
1*4Y	13	-	14	2	2Y	16	-	
1*5Y	19	-	21	1	3Y	17	1	
2*3Y	4	-2	5	-1	4Y	18	-	
2*4Y	12	-1	12	-	5Y	17	-	
2*5Y	18	-1	19	-1				
3*4Y	8	1	7	1				
3*5Y	14	1	14	-				
4*5Y	6	-	7	-1				
5*7Y	11	-	11	3				
5*10Y	26	-	18	2				

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

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	25	7	35
今日	0	25	5	35



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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或者有效的信息, 其知识仅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, 也不保证其准确性、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