



【2024-04-17】

中国央行开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.8%。当日有 1700 亿元 1 年期中期借贷便利（MLF）和 20 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1700 亿元。资金面整体偏松，7d repo fixing：1.95%，与上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing:2.0490%，与上一交易日下降 0.9 个 bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.10%附近，后震荡成交在 2.10%-2.11%区间附近，午盘报收 11/10.75。中午回来，5y repo 区间内震荡，成交在 2.105%-2.11%附近，报收 10.75/10.5。1y repo，震荡成交在 1.9275%-1.945%区间附近，下午尾盘报收 94/93.75。其他期限，2y repo 成交在 1.9425%附近，1m repo 成交在 1.98%附近，9m repo 成交在 1.9425%附近。曲线方面，1x5 repo 成交在 16.75-17.25bp 附近，报收 17/16.5，1x2x5y repo 成交在-16.5bp 附近。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.05%-2.0575%附近，报收 05.25/04.5。2y shibor 成交在 2.0525%-2.06%附近，报收 06.25/05.5。5y shibor 报收 27.25/26。曲线方面，1x2y shibor 成交在 0.00-0.25bp 附近。基差方面，1y basis 成交在 11.25bp 附近，报收 11.5/10.75，5y basis 报收 16/15.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/4/17 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	1.98	2				3 M	1.75	5									
6 M	1.96	1	6 M	2.03	-1	6 M	1.7	-									
9 M	1.95	1	9 M	2.04	-	9 M	1.74	-1									
1 Y	1.94	1	1 Y	2.05	-	1 Y	1.65	2				1Y	1.94	1			
2 Y	1.94	1	2 Y	2.06	-	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	1			
3 Y	1.98	-	3 Y	2.13	1	3 Y	1.83	-2	3 Y	1.77	-	3Y	1.96	1			
4 Y	2.04	-	4 Y	2.19	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.02	1			
5 Y	2.1	-1	5 Y	2.27	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.06	1			
7 Y	2.21	-	7 Y	2.36	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.36	-	10Y	2.43	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.95	5.00	3M Shibor	2.049	-0.90	0-N Shibor	1.723	0.80	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	-2	-1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	-1	-	1	1			
9M*1Y	-1	-	1	-	6M	7	-2
1*2Y	0	-	1	-	9M	9	-1
1*3Y	4	-1	8	1	1Y	11	-1
1*4Y	10	-1	14	-	2Y	12	-1
1*5Y	16	-2	22	-	3Y	15	1
2*3Y	4	-1	7	1	4Y	18	-
2*4Y	10	-1	13	-	5Y	17	1
2*5Y	16	-2	21	-			
3*4Y	6	-	6	-1			
3*5Y	12	-1	14	-1			
4*5Y	6	-1	8	-			
5*7Y	11	1	9	-			
5*10Y	26	1	16	-			

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	0	23	6	32
今日	0	23	6	30

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评及更多资讯

免责声明:

以上所述及附送的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，并非投资建议/或者有约束力的信息，其知识/内容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