



【2024-04-15】

 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。今日有 40 亿元逆回购到期。资金面整体偏松，7d repo fixing: 1.9%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 2.0710%，与上一交易日下降 1.9bp。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.095%附近，后震荡成交在 2.095%-2.105%区间附近，午盘报收 10.25/09.75。中午回来，5y repo 小幅震荡上行，成交在 2.10%-2.1175%附近，报收 11.75/11.5。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.9075%-1.9375%区间附近，尾盘报收 93.75/93.5。其他期限，4y repo 成交在 2.03%附近。曲线方面，1x5 repo 成交在 18bp 附近，报收 18/17.5。

 Shibor 端，今日交投清淡。1y shibor 报收 5.25/4.75，5y shibor 报收 27/26.5。基差方面，1y basis 报收 11.75/11.25，5y basis 报收 15.5/15。其他方面，报价寥寥，未闻成交。

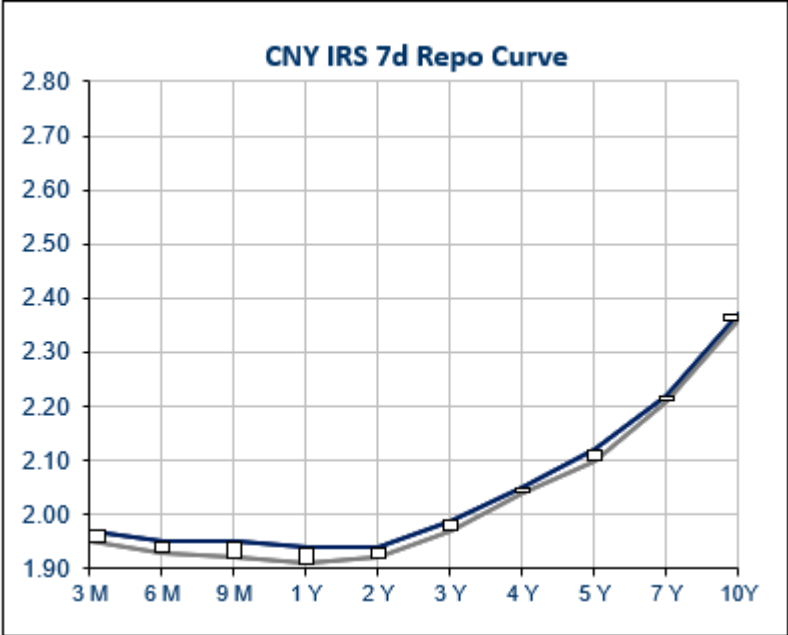
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/4/15 Monday

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	1.97	2				3 M	1.75	-									
6 M	1.95	2	6 M	2.04	-	6 M	1.75	-									
9 M	1.95	3	9 M	2.04	-	9 M	1.75	-									
1 Y	1.94	3	1 Y	2.05	1	1 Y	1.63	-2				1Y	1.93	2			
2 Y	1.94	2	2 Y	2.05	-1	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.92	1			
3 Y	1.99	2	3 Y	2.12	-	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.95	1			
4 Y	2.05	1	4 Y	2.19	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.01	1			
5 Y	2.12	2	5 Y	2.27	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.06	1			
7 Y	2.22	1	7 Y	2.37	-1				7 Y	1.8	-						
10Y	2.37	1	10Y	2.44	-1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.90	-	3M Shibor	2.071	-1.90	0-N Shibor	1.716	-0.10	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	1	0	-				
9M*1Y	-1	-	1	1	6M	9	-2	
1*2Y	0	-1	0	-2	9M	9	-3	
1*3Y	5	-1	7	-1	1Y	11	-2	
1*4Y	11	-2	14	-1	2Y	11	-3	
1*5Y	18	-1	22	-	3Y	13	-2	
2*3Y	5	-	7	1	4Y	18	-	
2*4Y	11	-1	14	1	5Y	15	-1	
2*5Y	18	-	22	2				
3*4Y	6	-1	7	-				
3*5Y	13	-	15	1				
4*5Y	7	1	8	1				
5*7Y	10	-1	10	-2				
5*10Y	25	-1	17	-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	0	25	5	34
今日	0	23	5	32



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:
以上所发及附发的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的利/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国新证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国新证券”) 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、建议或诱导。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其所提供、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