



【2024-04-22】

中国央行今日开展 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%，与上一交易日不变，3m shibor fixing:2.0270%，与上一交易日下降 0.8bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.0825%附近，小幅震荡上行，成交在 2.08%-2.0875%区间附近，午盘报收 08.75/08.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.085%-2.0875%区间附近，报收 08.75/08.25。1y repo，震荡成交在 1.925%-1.9275%区间附近，尾盘报收 93/92.75。其他期限，2y repo 成交在 1.9225%点位。曲线方面，1x5y repo 成交在 15.75-16bp 区间附近，报收 16/15.5。1x2y repo 成交在 -00.5bp 点位，报收 0/-0.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 02.5/02。5y shibor 报收 21. 5/20.5。基差方面， 1y basis 报收 9.75/9，5y basis 成交在 14bp，报收 12.75/12.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

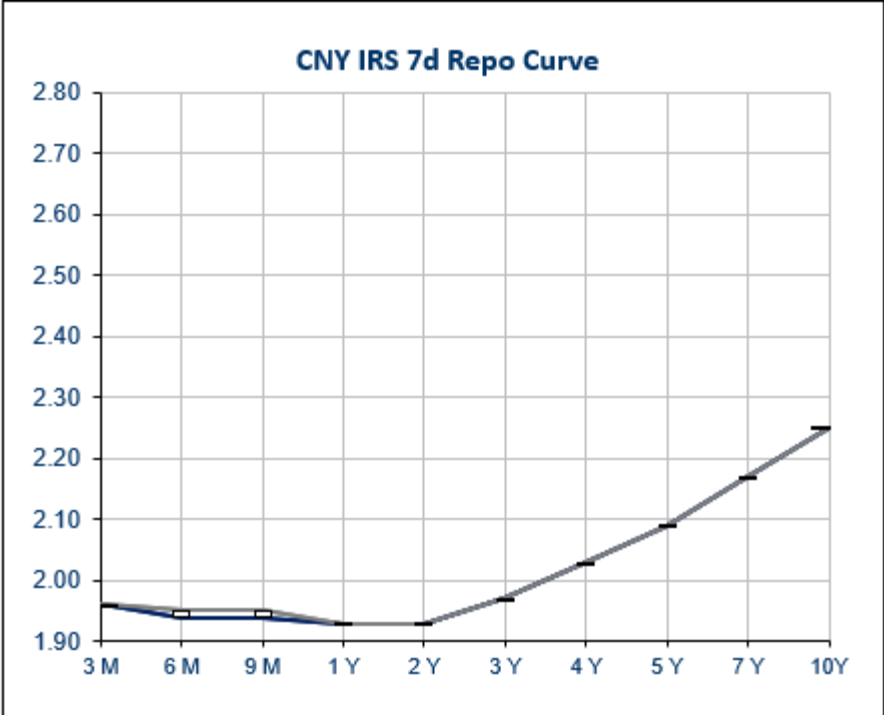
2024/4/22 Monday

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	1.96	-				3 M	1.75	-						
6 M	1.94	-1	6 M	2	-	6 M	1.7	-5						
9 M	1.94	-1	9 M	2.02	-	9 M	1.75	-						
1 Y	1.93	-	1 Y	2.02	-1	1 Y	1.65	-				1Y	1.93	-
2 Y	1.93	-	2 Y	2.03	-	2 Y	1.7	2	2 Y	1.65	-	2Y	1.92	-1
3 Y	1.97	-	3 Y	2.07	-2	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.94	-1
4 Y	2.03	-	4 Y	2.14	-2				4 Y	1.8	-	4Y	2.01	-
5 Y	2.09	-	5 Y	2.21	-3				5 Y	1.8	-	5Y	2.04	-
7 Y	2.17	-	7 Y	2.3	-3				7 Y	1.8	-			
10Y	2.25	-	10Y	2.38	-3				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-	3M Shibor	2.027	-0.80	0-N Shibor	1.78	-1.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	-	2	-				
9M*1Y	-1	1	0	-1	6M	6	1	
1*2Y	0	-	1	1	9M	8	1	
1*3Y	4	-	5	-1	1Y	9	-1	
1*4Y	10	-	12	-1	2Y	10	-	
1*5Y	16	-	19	-2	3Y	10	-2	
2*3Y	4	-	4	-2	4Y	18	-	
2*4Y	10	-	11	-2	5Y	12	-3	
2*5Y	16	-	18	-3				
3*4Y	6	-	7	-				
3*5Y	12	-	14	-1				
4*5Y	6	-	7	-1				
5*7Y	8	-	9	-				
5*10Y	16	-	17	-				

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	22	3	28
今日	-1	21	3	26



联系人: Ruby Wu
邮箱: viaoting.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:
以上所述及所加的所有信息 (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