



【2024-04-19】

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。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。资金面整体均衡偏松，7d repo fixing：1.90%，与上一交易日不变，3m shibor fixing:2.0350%，与上一交易日下降 0.6bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.0825%附近，后震荡成交在 2.0825-2.09%区间附近，午盘报收 09/08.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.0875%-2.0925%附近，报收 09.25/09。1y repo，震荡成交在 1.9225%-1.935%区间附近，尾盘报收 93.5/93.25。其他期限，2y repo 成交在 1.9325%-1.93%附近，4y repo 成交在 2.0275%附近。曲线方面，2x5y repo 成交在 15.75bp 附近，4x5 repo 成交在 06bp 附近，1x5 repo 成交在 16-15.75bp 附近，报收 16/15.75。

Shibor 端，1y shibo 成交在 2.0325%附近，报收 03/02.75，2y shibor 成交在 2.0325%附近，5y shibor 成交在 2.235%附近，报收 23.75/23.25。曲线方面，1x5y shibor 成交在 20.25bp 附近，报收 21/20.25。基差方面，5y basis 成交在 14.5bp 附近，报收 14.75/14.5，1y basis 报收 10/09.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

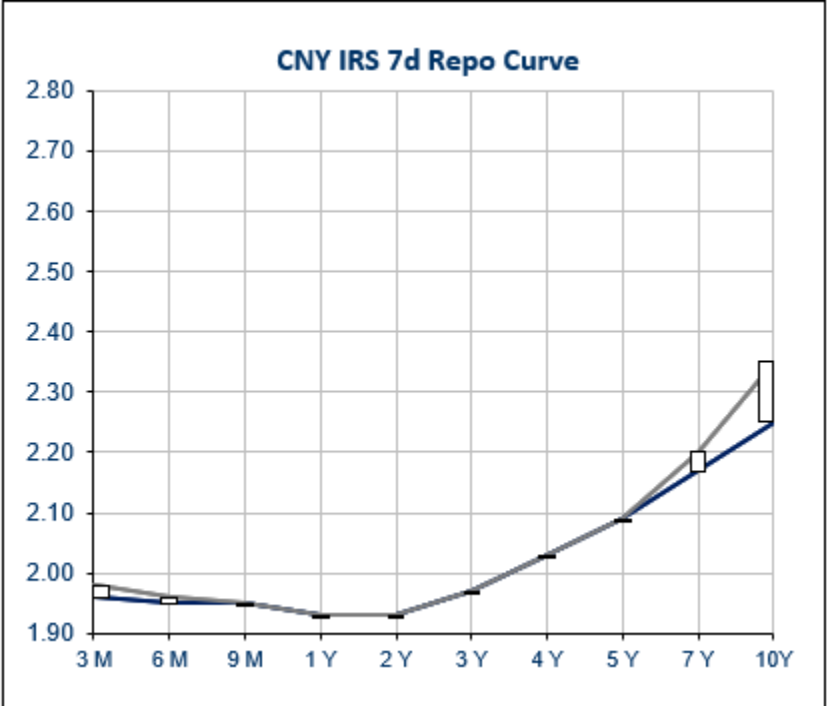
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/4/19 Friday

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	-2				3 M	1.75	5						
6 M	1.95	-1	6 M	2	-2	6 M	1.75	4						
9 M	1.95	-	9 M	2.02	-	9 M	1.75	2						
1 Y	1.93	-	1 Y	2.03	-1	1 Y	1.65	-				1Y	1.93	-
2 Y	1.93	-	2 Y	2.03	-1	2 Y	1.675	2	2 Y	1.65	-	2Y	1.93	1
3 Y	1.97	-	3 Y	2.09	-1	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.95	1
4 Y	2.03	-	4 Y	2.16	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.01	-
5 Y	2.09	-	5 Y	2.24	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.04	-
7 Y	2.17	-3	7 Y	2.33	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.25	-10	10Y	2.41	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-	3M Shibor	2.035	-0.60	0-N Shibor	1.797	2.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-1	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	0	1	2	2				
9M*1Y	-2	-	1	-1	6M	5	-1	
1*2Y	0	-	0	-	9M	7	-	
1*3Y	4	-	6	-	1Y	10	-1	
1*4Y	10	-	13	-	2Y	10	-1	
1*5Y	16	-	21	-	3Y	12	-1	
2*3Y	4	-	6	-	4Y	18	-	
2*4Y	10	-	13	-	5Y	15	-1	
2*5Y	16	-	21	-				
3*4Y	6	-	7	-				
3*5Y	12	-	15	-				
4*5Y	6	-	8	-				
5*7Y	8	-3	9	-				
5*10Y	16	-10	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	-1	22	4	29
今日	0	22	3	28



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:
以上所述及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或者有别的意图, 其知识产权属于上海国际货币经纪有限公司 (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任何投资建议, 投资者应自行承担决策相关的报价、定价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、及时性或完整性等要求, 且可未经通知而进行修改, 所有前述和保证均按明确免责声明声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang