



【2024-04-09】

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。资金面整体偏松，7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing:2.12%，与上一交易日下降 1.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.1325%附近，小幅震荡下行，成交在 2.1325%-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 2.1275%-2.1225%区间附近，报收 13/12.5。1y repo，震荡成交在 1.9575%-1.9475%区间附近，尾盘报收 95.75/95.5。其他期限，3m repo 成交在 2.0275%附近，6m repo 成交在 1.985%-1.9925%附近，9m repo 成交在 1.9725%-1.975%附近，2y repo 成交在 1.955%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-2bp，6mx1y 成交在-3.5bp 附近，1x2 repo 成交在-0.25bp 附近。1x5 repo 成交在 17.25b 附近，报收 17.5/17。

Shibor 端，1y shibor 报收 10.25/09.75，2y shibor 成交在 2.105%-2.1075%附近，5y shibor 成交在 2.30%附近，报收 30/29.5。曲线方面，2x5y shibor 成交在 19.5bp 附近。基差方面，1y basis 报收 14.5/14，5y basis 报收 17.25/16.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

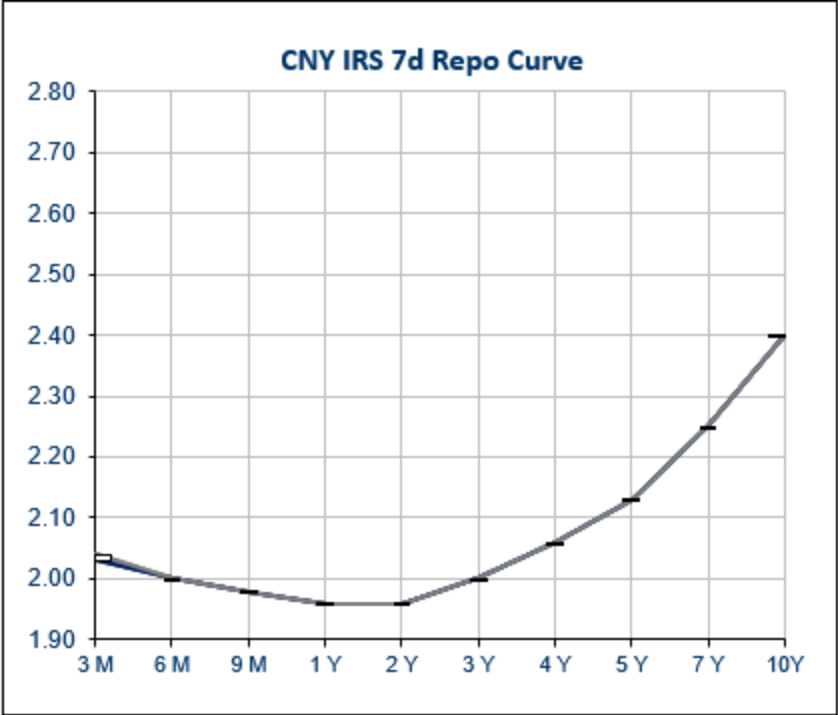
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/4/9 Tuesday

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	2.03	-1				3 M	1.75	-									
6 M	2	-	6 M	2.09	-3	6 M	1.75	-									
9 M	1.98	-	9 M	2.08	-2	9 M	1.75	-									
1 Y	1.96	-	1 Y	2.1	-2	1 Y	1.63	-				1Y	1.96	-			
2 Y	1.96	-	2 Y	2.1	-3	2 Y	1.65	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-			
3 Y	2	-	3 Y	2.14	-3	3 Y	1.85	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.97	-			
4 Y	2.06	-	4 Y	2.23	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.03	-			
5 Y	2.13	-	5 Y	2.3	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.08	-			
7 Y	2.25	-	7 Y	2.4	-3				7 Y	1.8	-						
10Y	2.4	-	10Y	2.5	-2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.95	-5.00	3M Shibor	2.12	-1.30	0-N Shibor	1.718	0.70	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO
3M*6M	-3 1		Tenor	Mid Δ bp
6M*9M	-2 -	-1 1		
9M*1Y	-2 -	2 -	6M	9 -3
1*2Y	0 -	0 -1	9M	10 -2
1*3Y	4 -	4 -1	1Y	14 -2
1*4Y	10 -	13 1	2Y	14 -3
1*5Y	17 -	20 2	3Y	14 -3
2*3Y	4 -	4 -	4Y	18 -
2*4Y	10 -	13 2	5Y	17 -
2*5Y	17 -	20 3		
3*4Y	6 -	9 2		
3*5Y	13 -	16 3		
4*5Y	7 -	7 1		
5*7Y	12 -	10 -3		
5*10Y	27 -	20 -2		

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	45	44	41	40	37	36	37
今日	45	44	41	40	37	36	37

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	3	24	9	34
今日	2	23	7	33



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”) 或第三方。“信息”不应也不应被解释为与任何金融工具、股票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处理。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN