



【2024-08-19】

中国央行今日进行 521 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.70%，与此前持平。因今日有 745 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 224 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.85%，与上一交易日下降 1bp，3m shibor fixing: 1.8370%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.835%附近，后震荡成交在 1.835%-1.8425%区间附近，午盘报收 84/83.5。中午回来，5y repo 小幅震荡下行，成交在 1.825%-1.8325%区间附近，报收 82.75/82.5。1y repo 全天震荡成交在 1.7475%-1.7525%区间附近，报收 75.25/75。其他期限，2y repo 成交在 1.73%-1.74%区间附近，4y repo 成交在 1.7925%-1.7975%区间附近。曲线方面，2x4y repo 成交在 5.75bp 点位，2x5y repo 成交在 9.75-10bp 区间附近，1x5y repo 报收 7.5/7.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 83.25/82.75，5y shibor 报收 89.75/88.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 06.75/05.5。基差方面，1y basis 报收 08/07.75，5y basis 成交在 6.75bp 点位，报收 07/06.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

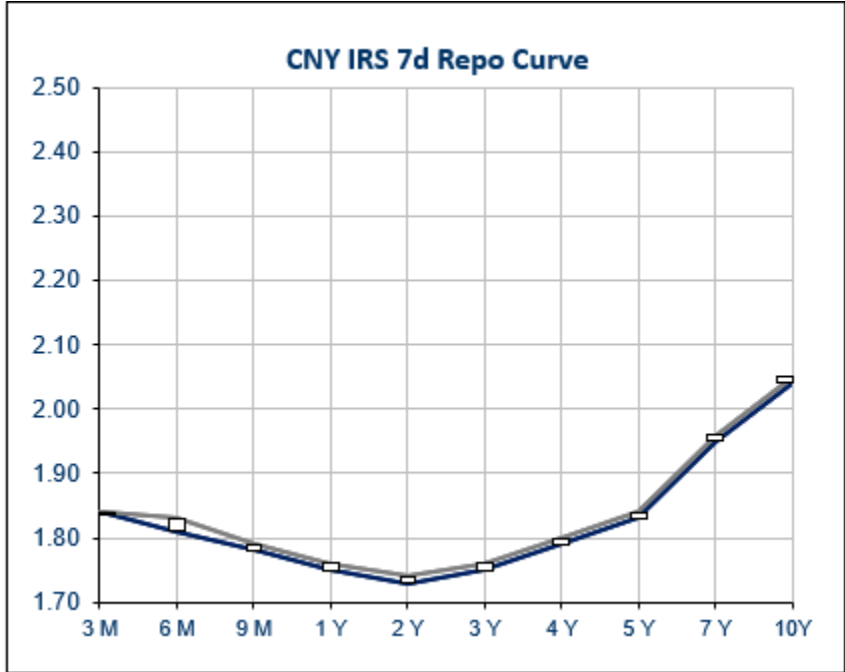
2024/8/19 Monday

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	1.84	–				3 M	1.69	–6							
6 M	1.81	–2	6 M	1.88	–4	6 M	1.67	–1							
9 M	1.78	–1	9 M	1.86	–1	9 M	1.65	–10							
1 Y	1.75	–1	1 Y	1.83	–1	1 Y	1.65	–10				1Y	1.74	–	
2 Y	1.73	–1	2 Y	1.81	–	2 Y	1.62	–	2 Y	1.65	–	2Y	1.7	–1	
3 Y	1.75	–1	3 Y	1.81	–1	3 Y	1.75	–	3 Y	1.77	–	3Y	1.71	–1	
4 Y	1.79	–1	4 Y	1.85	–1				4 Y	1.8	–	4Y	1.75	–1	
5 Y	1.83	–1	5 Y	1.89	–2				5 Y	1.8	–	5Y	1.78	–2	
7 Y	1.95	–1	7 Y	1.97	–3				7 Y	1.8	–				
10Y	2.04	–1	10Y	2.07	–1				10Y	1.8	–				
7D REPO	1.85	–1.00	3M Shibor	1.8370	–0.10	0-N Shibor	1.682	–1.80	1Y DEPO	1.50					

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-2			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	1	-2	3				
9M*1Y	-3	-	-3	-	6M	7	-2	
1*2Y	-2	-	-2	1	9M	8	-	
1*3Y	0	-	-2	-	1Y	8	-	
1*4Y	4	-	2	-	2Y	8	1	
1*5Y	8	-	6	-1	3Y	6	-	
2*3Y	2	-	0	-1	4Y	6	-	
2*4Y	6	-	4	-1	5Y	6	-1	
2*5Y	10	-	8	-2				
3*4Y	4	-	4	-				
3*5Y	8	-	8	-1				
4*5Y	4	-	4	-1				
5*7Y	12	-	8	-1				
5*10Y	21	-	18	1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	34	33	27	25	23	22
今日	36	33	32	27	25	23	22

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	3	31	10	39
今日	4	32	11	40



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting.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:
以上所发及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 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、建议或诱导。“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, 所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang