



【2024-08-14】

中国央行今日进行 3692 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.70%，与此前持平。今日无逆回购到期，当日实现净投放 3692 亿元。资金面上午均衡，下午转松。7d repo fixing: 1.92%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 1.8380%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.82%附近，后震荡成交在 1.8125%-1.83%区间附近，午盘报收 82.75/82.5。中午回来，5y repo 小幅上升，震荡成交在 1.8375%-1.8475%区间附近，报收 84/83.75。1y repo 全天震荡成交在 1.7225%-1.7575%区间附近，报收 75/74.5。其他期限，2y repo 成交在 1.725%-1.7425%。曲线方面，1x2y repo 成交在-01.25bp 到-01.5 点位，2x5y repo 成交在 10.5bp 点位，1x5y repo 成交在 08.75bp 点位，报收 9.5/9。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 84.25/83，5y shibor 报收 91.25/89.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 08/05.5。基差方面，1y basis 报收 09.25/08，5y basis 报收 07/06。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

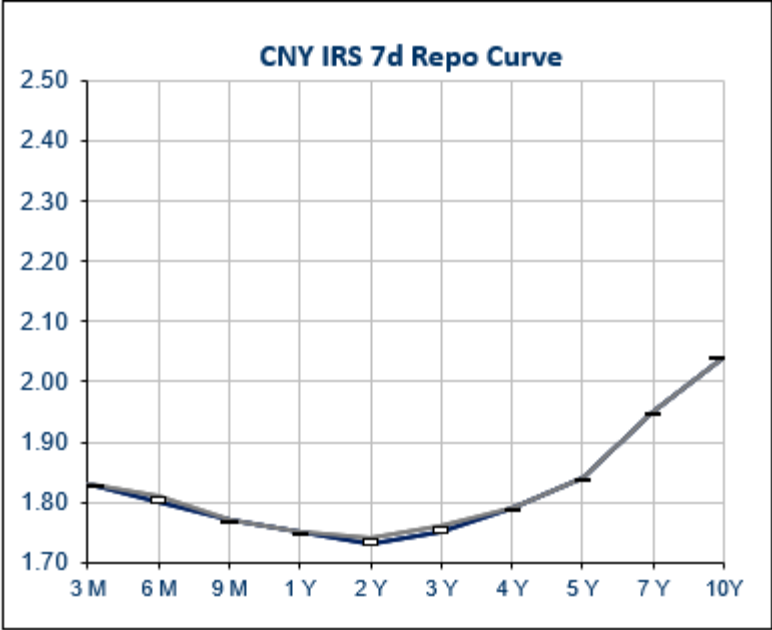
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/8/14 Wednesday

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd									OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1. 83	-				3 M	1. 7	-						
6 M	1. 8	-1	6 M	1. 89	-	6 M	1. 67	-						
9 M	1. 77	-	9 M	1. 86	-	9 M	1. 75	-						
1 Y	1. 75	-	1 Y	1. 84	-	1 Y	1. 75	-				1Y	1. 74	-1
2 Y	1. 73	-1	2 Y	1. 82	1	2 Y	1. 63	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 71	-
3 Y	1. 75	-1	3 Y	1. 81	-	3 Y	1. 75	-	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 72	-1
4 Y	1. 79	-	4 Y	1. 85	-				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 76	-
5 Y	1. 84	-	5 Y	1. 9	-				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 79	-2
7 Y	1. 95	-	7 Y	1. 99	-				7 Y	1. 8	-			
10Y	2. 04	-	10Y	2. 07	-				10Y	1. 8	-			
7D REPO	1.92	-3.00	3M Shibor	1. 838	0.10	O-N Shibor	1.842	-8.60	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-1			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	-3	1	-3	-				
9M*1Y	-2	-	-2	-	6M	9	1	
1*2Y	-2	-1	-2	1	9M	9	-	
1*3Y	0	-1	-3	-	1Y	9	-	
1*4Y	4	-	1	-	2Y	9	2	
1*5Y	9	-	6	-	3Y	6	1	
2*3Y	2	-	-1	-1	4Y	6	-	
2*4Y	6	1	3	-1	5Y	6	-	
2*5Y	11	1	8	-1				
3*4Y	4	1	4	-				
3*5Y	9	1	9	-				
4*5Y	5	-	5	-				
5*7Y	11	-	9	-				
5*10Y	20	-	17	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	37	34	33	27	25	23	22
今日	36	34	32	27	24	23	22

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	3	35	10	40
今日	1	32	7	36



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiangling.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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的、或者专用的信息。其知识“仅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任何投资建议。投资者在任何交易决策相关的报价、定价、建议或决策, 也不应作为决策依据, 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

文 / Joyce Zhang