



【2023-08-29】

中国人民银行今日开展 3850 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 1110 亿元逆回购到期，当日实现净投放 2740 亿元。资金面均衡。7d repo fixing:2.25%，较上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing: 2.0280%，较上一交易日上升 0.8bp。

Repo 端，5y repo 早盘开在 2.36%，随国债期货下行，5y repo 上行成交在 2.36%-2.38%，午盘报收 39/38.5。1y repo 成交在 1.93%-1.95%区间附近，午后，随期货企稳，5y repo 震荡回落成交在 2.38%-2.365%附近，尾盘回踩报收 36.5/36.25。1y repo 成交在 1.94%附近，报收 94/93.5。其他期限，3m repo 成交在 1.92%-1.9125%，6m repo 成交在 1.935%，2y repo 成交在 2.05%-2.035%。曲线方面，3m×6m repo spd 成交在 01.75~02bp，6mx1y repo spd 成交在 01.5bp，1x2y repo spd 成交在 09bp，1x5y repo spd 成交在 43.25bp-42.5bp，报收 42.75/42.5。

Shibor 端，总体随 repo 冲高回落 5y shibor 成交在 2.635%-2.6675%，报收 63.75/63.5。1y shibor 成交在 2.12%-2.1525%，报收 13.5/12.5。Basis 方面，5y basis，成交在 27.75bp 报收 27.5/27。1y basis 成交在 19.25bp，报收 19.5/18.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

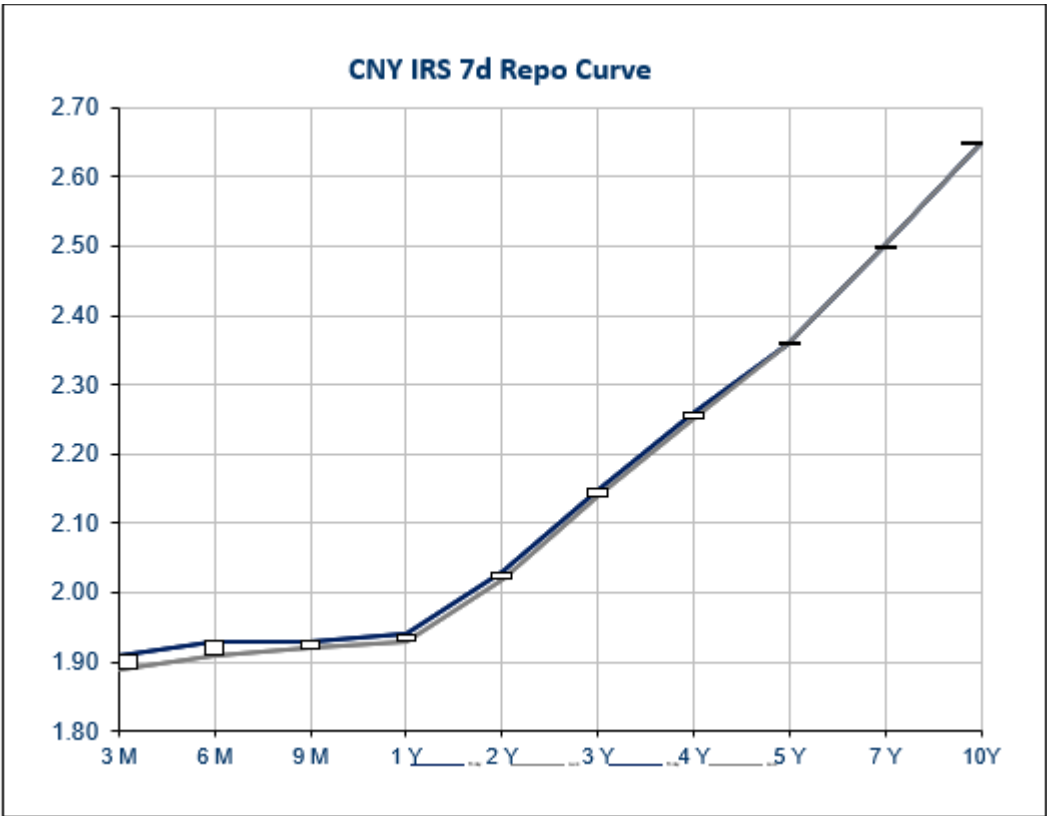
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2023/8/29 星期二

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	1.91	2				3 M	1.54	-						
6 M	1.93	2	6 M	2.11	2	6 M	1.51	-						
9 M	1.93	1	9 M	2.12	2	9 M	1.52	-						
1 Y	1.94	1	1 Y	2.13	2	1 Y	1.53	-				1Y	1.91	-
2 Y	2.03	1	2 Y	2.24	1	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.98	-
3 Y	2.15	1	3 Y	2.36	1	3 Y	1.95	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.09	-1
4 Y	2.26	1	4 Y	2.51	2				4 Y	1.8	-	4Y	2.1975	-1
5 Y	2.36	-	5 Y	2.63	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.285	0
7 Y	2.5	-	7 Y	2.79	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.65	-	10Y	2.89	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.25	5.00	3M Shibor	2.028	0.80	O-N Shibor	1.973	6.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	2	-			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	0	-1	1	-			
9M*1Y	1	-	1	-	6M	18	-
1*2Y	9	-	11	-1	9M	19	1
1*3Y	21	-	23	-1	1Y	19	1
1*4Y	32	-	38	-	2Y	21	-
1*5Y	42	-1	50	-1	3Y	21	-
2*3Y	12	-	12	-	4Y	25	1
2*4Y	23	-	27	1	5Y	27	1
2*5Y	33	-1	39	-			
3*4Y	11	-	15	1			
3*5Y	21	-1	27	-			
4*5Y	10	-1	12	-1			
5*7Y	14	-	16	-1			
5*10Y	29	-	26	-1			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	51	51	48	48	49	50	51
今日	51	51	48	48	49	50	51

Bond Swap	230015/5y repo	230012/5y repo	230203/5y repo	230210/5y repo
昨日	4	25	13	32
今日	4	23	13	33



联系人: Ruby Hu
邮箱: ruby.hu@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证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际证券”) 或第三方。“信息”不能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素。您可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均按所述免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN