



【2024-08-23】

中国央行今日进行 3793 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 1378 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 2415 亿元。资金面上午均衡偏紧，下午整体均衡。7d repo fixing：1.92%，与上一交易日上升 1bp，3m shibor fixing: 1.8440%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.8325%附近，后震荡上行，成交在 1.8325%-1.8475%区间附近，午盘报收 84/83.75。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 1.83%-1.84%区间附近，报收 83.25/82.75。1y repo 全天震荡成交在 1.775%-1.79%区间附近，报收 77.5/77。其他期限，3m repo 成交在 1.885%附近，6m repo 成交在 1.86%-1.87%区间附近，9m repo 成交在 1.82%-1.8225%区间附近，2y repo 成交在 1.7675%附近，3y repo 成交在 1.765%-1.7675%区间附近。曲线方面，9mx5y repo 成交在 2.25bp 点位，6mx9m 成交在 -3.75~-4bp 区间附近，9mx1y repo 成交在 -3.25bp 点位，1x5y repo 成交在 5.5-5.75bp 区间附近，报收 6/5.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 86.75/86， 5y shibor 报收 90.75/90.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 04.75/03.75。基差方面，1y basis 报收 09.25/08.5，5y basis 报收 08/07.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

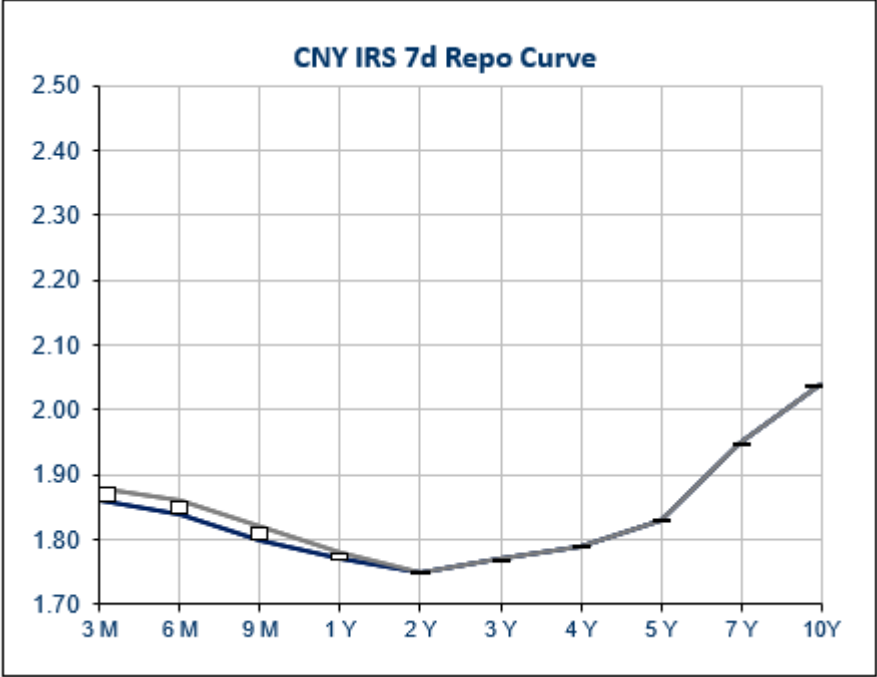
2024/8/23 Friday

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	1.86	-2				3 M	1.7	-1									
6 M	1.84	-2	6 M	1.93	1	6 M	1.69	-									
9 M	1.8	-2	9 M	1.9	-	9 M	1.65	-1									
1 Y	1.77	-1	1 Y	1.86	-1	1 Y	1.65	-				1Y	1.76	-1			
2 Y	1.75	-	2 Y	1.83	-1	2 Y	1.64	1	2 Y	1.65	-	2Y	1.72	-1			
3 Y	1.77	-	3 Y	1.84	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.73	-			
4 Y	1.79	-	4 Y	1.87	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.77	-			
5 Y	1.83	-	5 Y	1.91	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.79	-			
7 Y	1.95	-	7 Y	1.98	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.04	-	10Y	2.05	-2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.92	1.00	3M Shibor	1.844	0.10	0-N Shibor	1.801	3.60	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	-	-3 -1				
9M*1Y	-3	1	-4 -1	6M	9	3	
1*2Y	-2	1	-3 -	9M	10	2	
1*3Y	0	1	-2 1	1Y	9	-	
1*4Y	2	1	1 1	2Y	8	-1	
1*5Y	6	1	5 1	3Y	7	-	
2*3Y	2	-	1 1	4Y	8	-	
2*4Y	4	-	4 1	5Y	8	-	
2*5Y	8	-	8 1				
3*4Y	2	-	3 -				
3*5Y	6	-	7 -				
4*5Y	4	-	4 -				
5*7Y	12	-	7 -				
5*10Y	21	-	14 -2				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	33	32	27	25	23	22
今日	36	33	31	27	24	22	21

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	2	31	11	40
今日	-1	30	9	40



联系人: Ruby Yu
邮箱: yuoting.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, 且为保密的利/或者专用的信息。其知识产权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、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、及时性或客观性等要求, 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