



【2023-08-28】

中国央行今日开展 3320 亿元逆回购操作，因今日有 340 亿元逆回购到期，当日实现净投放 2980 亿元。资金面均衡偏紧。7d repo fixing:2.20%，较上一交易日上升 5bp，3m shibor fixing: 2.0200%，较上一交易日上升 0.6bp。

Repo 端，5y repo 早盘高开在 2.40%，上午股市高开+5%后一度回调，5y repo 下行成交在 2.40%-2.37%附近，午盘报收 37.25/36.75。午后，期货缓慢上行，股市继续震荡下行，5y repo 震荡下行成交在 2.3725%-2.3525%附近，尾盘有轻微回升，报收 35.75/35.5。1y repo 上午下行成交在 1.955%-1.9375%区间附近，午盘报收 94/93.5。午后，1y repo 继续下行，成交在 1.935%-1.9275%区间附近，报收 93/92.75。其他期限，9m repo 成交在 1.9225%附近，2y repo 成交在 2.055%-2.0375%。曲线方面，9mx1y repo spd 成交在 01.25bp 附近，9mx5y repo spd 成交在 44.5bp，1x2y repo spd 成交在 09bp，1x5y repo spd 成交在 42.75bp 附近，报收 43/42.5。

Shibor 端，5y shibor 成交在 2.64%-2.625%附近，报收 62.25/61.75。1y shibor 成交在 2.1225%-2.11%附近，报收 11.5/11。曲线方面，1x5y shibor spd 报收 51.75/51.25。Basis 方面，5y basis 报收 27.25/26.75。1y basis 成交在 18bp 附近，报收 18.25/17.75。

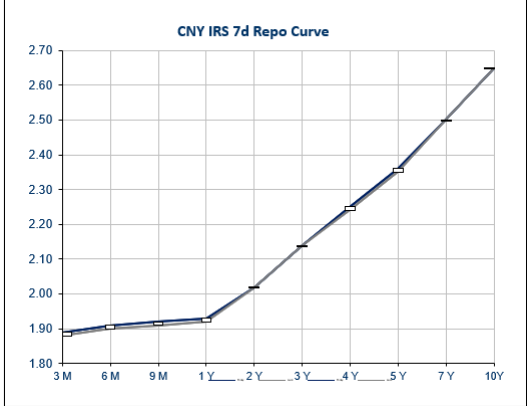
其他方面，报价寥寥，未闻成交。
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2023/8/28 星期一

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	1.89	1				3 M	1.54	-						
6 M	1.91	1	6 M	2.09	1	6 M	1.51	-						
9 M	1.92	1	9 M	2.1	1	9 M	1.52	-						
1 Y	1.93	1	1 Y	2.11	1	1 Y	1.53	-				1Y	1.91	1
2 Y	2.02	-	2 Y	2.23	2	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.98	-
3 Y	2.14	-	3 Y	2.35	-	3 Y	1.95	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.095	2
4 Y	2.25	1	4 Y	2.49	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.205	2
5 Y	2.36	1	5 Y	2.62	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.29	1
7 Y	2.5	-	7 Y	2.79	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.65	-	10Y	2.89	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.20	5	3M Shibor	2.02	0.60	O-N Shibor	1.91	9.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	2	-		Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	1	-	1	-			
9M*1Y	1	-	1	-	6M	18	-
1*2Y	9	-1	12	1	9M	18	-
1*3Y	21	-1	24	-1	1Y	18	-
1*4Y	32	-	38	-1	2Y	21	2
1*5Y	43	-	51	-1	3Y	21	-
2*3Y	12	-	12	-2	4Y	24	-1
2*4Y	23	1	26	-2	5Y	26	-1
2*5Y	34	1	39	-2			
3*4Y	11	1	14	-			
3*5Y	22	1	27	-			
4*5Y	11	-	13	-			
5*7Y	14	-1	17	-			
5*10Y	29	-1	27	-			

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	3	22	9	31
今日	4	25	13	32



联系人: Ruby Hu
邮箱: vincing.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:
以上所登及附登的所有信息 (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与任何金融工具、投资策略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, 也不保证其真实性、及时性或准确性等要素, 且可能随时进行修订, 所有陈述和保证均按前述免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang