



【2023-08-07】

中国央行今日开展 30 亿元逆回购操作，因今日有 310 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 280 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.72%，较上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 2.08%，较上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，早盘，5y repo 开在 2.465%，国债期货小幅上升后走低，5y repo 成交在 2.4625%-2.47%附近，临近午盘结束，国债期货继续下行，5y repo 上行 tkn 至 2.47%附近，午盘报收 47.25/47。午后，国债期货回升后横盘震荡，5y repo 下行 gvn 至 2.4575%。5y repo 下午成交在 2.4575%-2.4675%附近，报收 46/45.75。1y repo 早盘开在 1.9825%附近，受资金面均衡偏紧的影响，1y repo 震荡上行成交在 1.9875%-1.9925%附近，午盘报收 99.25/99。午后，资金回松，1y repo 下行，成交在 1.9775%-1.99%附近，报收 98.25/98。其他期限，3y repo 成交 2.235%-2.24%附近，曲线方面，3x5y repo spd 成交 23bp 附近，1x5y repo spd 成交在 48bp 附近，报收 48/47.75。

Shibor 端，5y shibor 报收 76.25/76，1y shibor 成交在 2.18%-2.1875%附近，报收 18.25/17.5。其他期限，3y shibor 成交 2.4725%附近。曲线方面，1x5y shibor spd 报收 58.75/57.75。Basis 方面，5y basis 报收 30.25/30，1y basis 报收 20/19.5。2y basis 成交在 22.25bp 附近，3y basis 成交在 23.5bp 附近。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/8/7 Monday

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	1.88	-				3 M	1.59	-						
6 M	1.93	-	6 M	2.12	-	6 M	1.51	-						
9 M	1.96	-	9 M	2.15	1	9 M	1.51	-						
1 Y	1.98	-	1 Y	2.18	1	1 Y	1.6	-				1Y	1.97	-
2 Y	2.09	-	2 Y	2.31	-1	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.06	-1
3 Y	2.23	-	3 Y	2.46	-	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.2	-1
4 Y	2.36	-	4 Y	2.62	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.32	-1
5 Y	2.46	-	5 Y	2.76	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.42	-1
7 Y	2.6	-	7 Y	2.93	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.75	-	10Y	3.03	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.72	2.00	3M Shibor	2.08	-0.50	O-N Shibor	1.518	37.70	1Y DEPO	1.50				

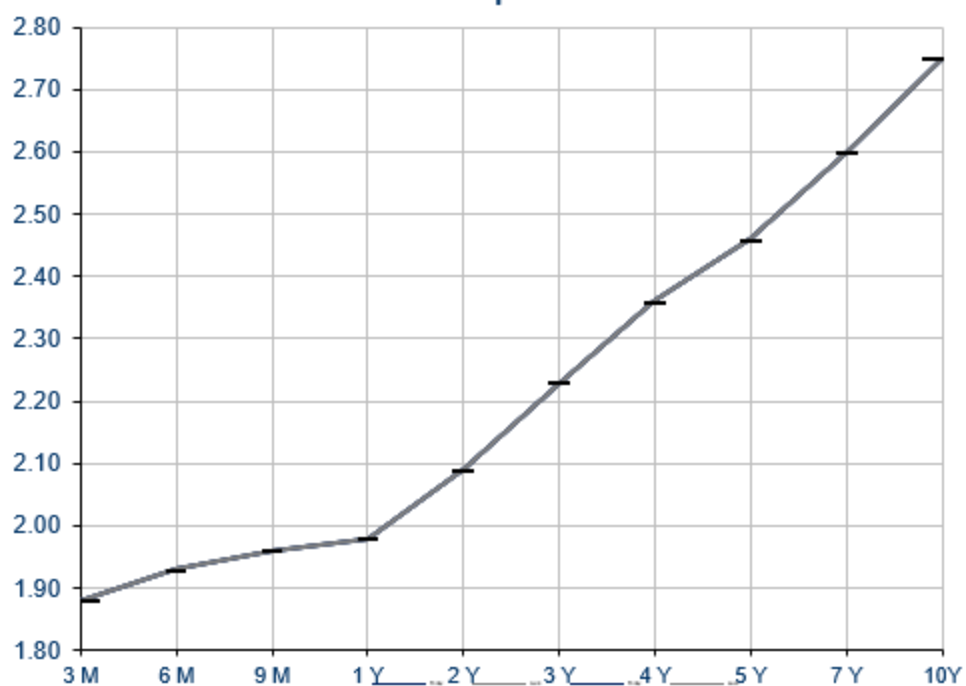
SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	5	-	Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	3	-	3	1	
9M*1Y	2	-	3	-	6M
1*2Y	11	-	13	-2	9M

1*3Y	25	-	28	-1	1Y	20	1
1*4Y	38	-	44	-1	2Y	22	-1
1*5Y	48	-	58	-1	3Y	23	-
2*3Y	14	-	15	1	4Y	26	-
2*4Y	27	-	31	1	5Y	30	-
2*5Y	37	-	45	1			
3*4Y	13	-	16	-			
3*5Y	23	-	30	-			
4*5Y	10	-	14	-			
5*7Y	14	-	17	-			
5*10Y	29	-	27	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	58	57	56	56	57	59	60
今日	58	57	56	56	57	59	60

Bond Swap	230002/5y repo	230004/5y repo	230203/5y repo	230205/5y repo
昨日	-5	21	5	36
今日	-4	20	6	36

CNY IRS 7d Repo Curve



联系人: Ruby Wu
邮箱: xlouting.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:

以上所发及附发的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供参考, 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”) 或其关联方。“信息”不应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报价、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求。且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均按披露免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN