



【2023-08-09】

中国央行今日进行 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.90%，与此前持平。因今日有 90 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 70 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.80%，与上一交易日不变，3m shibor fixing: 2.0740%，与上一交易日下降 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.4525%附近，后在 2.45%-2.4575%区间附近震荡成交，午盘报收 45.75/45.5。中午回来，5y repo 成交在 2.455%附近，后稍微震荡下行，成交在 2.4525%-2.4475%区间附近，尾盘回调成交到 2.4525-2.4575%附近，尾盘报收 46/45.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.995%-1.985%区间附近，尾盘报收 99.25/98.75。其他期限，6m rep o 成交在 1.9475%附近，9m repo 成交在 1.97%附近，2y repo 成交在 2.095%附近，3y repo 成交在 2.2275%附近，4y repo 成交在 2.3475%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在 02.25bp 附近，1x2y repo 成交在 11.25-11bp 附近，3x4y repo 成交在 12bp 附近，1x5y repo 成交在 46.5-46bp 附近，报收 47/46.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 18.5/17.5，5y shibor 报收 76.25/75.25。基差方面，1y basis 报收 19.25/18.75，5y basis 报收 30.25/29.5。

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

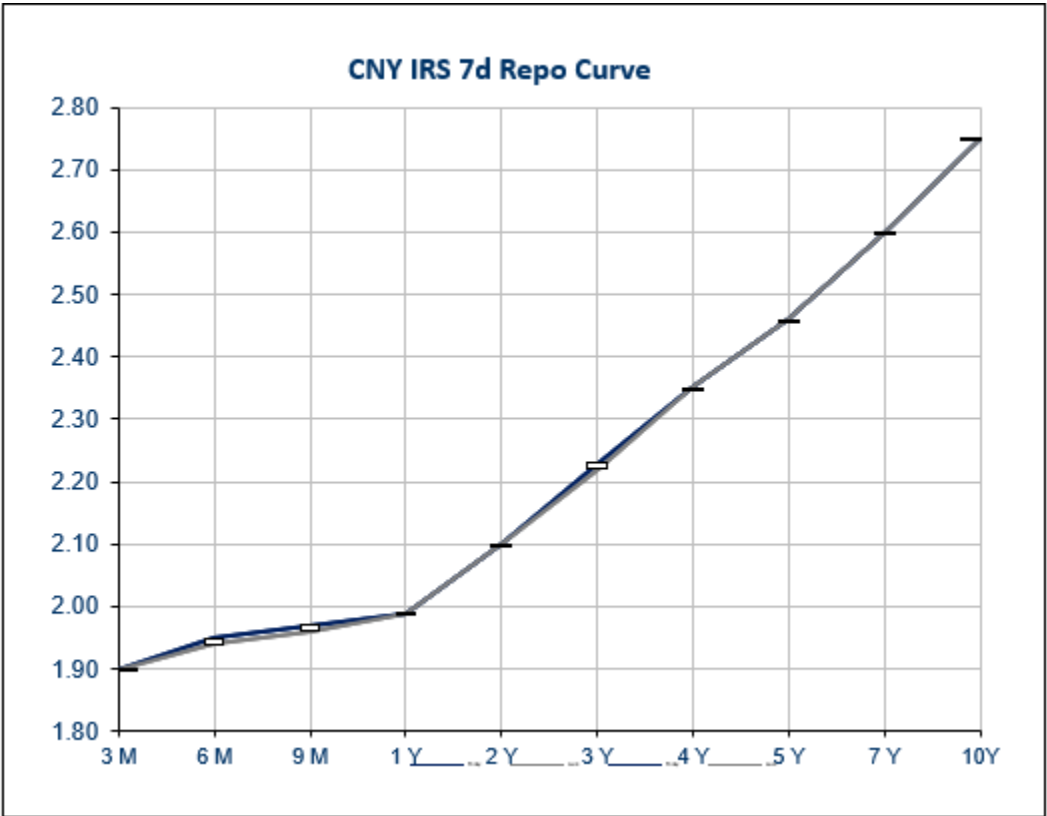
2023/8/9 Wednesday

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	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp			
3 M	1.9	-				3 M	1.59	-									
6 M	1.95	1	6 M	2.13	1	6 M	1.51	-									
9 M	1.97	1	9 M	2.16	1	9 M	1.51	-									
1 Y	1.99	-	1 Y	2.18	-	1 Y	1.6	-				1Y	1.97	-			
2 Y	2.1	-	2 Y	2.32	1	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.07	1			
3 Y	2.23	1	3 Y	2.46	-	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.2	1			
4 Y	2.35	-	4 Y	2.61	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.32	1			
5 Y	2.46	-	5 Y	2.76	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.41	-			
7 Y	2.6	-	7 Y	2.93	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.75	-	10Y	3.03	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.80	-	3M Shibor	2.074	-0.10	O-N Shibor	1.541	18.00	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	5	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	2	-	3	-				
9M*1Y	2	-1	2	-1	6M	18	-	
1*2Y	11	-	14	1	9M	19	-	
1*3Y	24	1	28	-	1Y	19	-	
1*4Y	36	-	43	-	2Y	22	1	
1*5Y	47	-	58	-	3Y	23	-	
2*3Y	13	1	14	-1	4Y	26	-	
2*4Y	25	-	29	-1	5Y	30	-	
2*5Y	36	-	44	-1				
3*4Y	12	-1	15	-				
3*5Y	23	-1	30	-				
4*5Y	11	-	15	-				
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	-4	21	6	35
今日	-5	21	6	35



联系人: Ruby Bu
邮箱: xiaoting.bu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所登及附加的所有信息 (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、时效性或准确性等需求。且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN