



【2024-08-28】

中国央行公开市场开展 2773 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率 1.70%，持平上次。今日有 2580 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 10bp，3m shibor fixing: 1.85%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.845%附近，后小幅震荡，成交在 1.845%-1.8575%区间附近，午盘报收 85/84.75。中午回来，5y repo 震荡下行，成交在 1.85%-1.835%区间附近，报收 83.5/83。1y repo 全天震荡成交在 1.76%-1.7675%区间附近，报收 75.75/75.25。其他期限，3m repo 成交在 1.8625%附近，9m repo 成交在 1.7925%附近，2y repo 成交在 1.7475%-1.74%附近。曲线方面，2x5y repo 成交在 09.5bp 附近，1x5y repo 成交在 07.75bp 附近，报收 08/07.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 86.75/85.5，5y shibor 成交在 1.935%-1.9275%附近，报收 93/92.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 7.25/6。基差方面，1y basis 报收 11/10.25，5y basis 成交在 09.5bp，报收 09.5/09.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

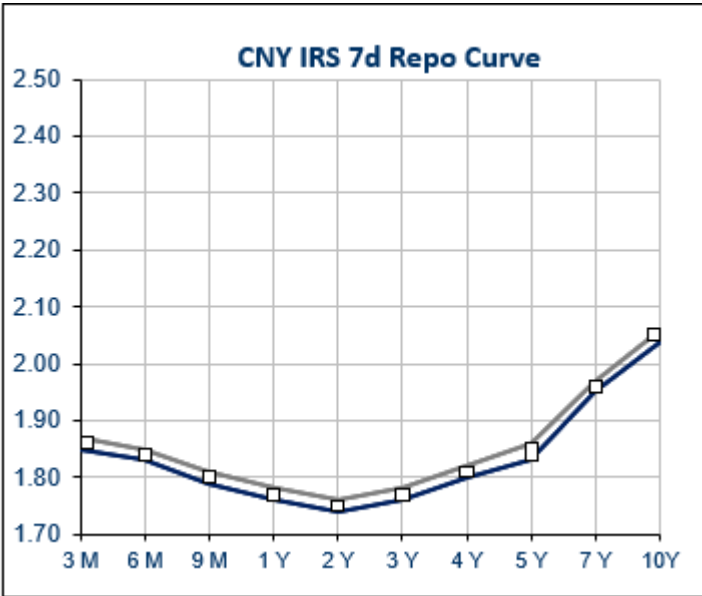
2024/8/28 Wednesday

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	1.85	-2				3 M	1.7	-1						
6 M	1.83	-2	6 M	1.93	-2	6 M	1.67	-1						
9 M	1.79	-2	9 M	1.89	-2	9 M	1.65	-1						
1 Y	1.76	-2	1 Y	1.86	-2	1 Y	1.68	3				1Y	1.75	-2
2 Y	1.74	-2	2 Y	1.84	-2	2 Y	1.63	-1	2 Y	1.65	-	2Y	1.71	-2
3 Y	1.76	-2	3 Y	1.85	-2	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.72	-2
4 Y	1.8	-2	4 Y	1.88	-3				4 Y	1.8	-	4Y	1.76	-2
5 Y	1.83	-3	5 Y	1.93	-3				5 Y	1.8	-	5Y	1.79	-2
7 Y	1.95	-2	7 Y	2	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.04	-2	10Y	2.08	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-10.00	3M Shibor	1.85	0.10	0-N Shibor	1.52	-14.70	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	-	-4	-				
9M*1Y	-3	-	-3	-	6M	10	-	
1*2Y	-2	-	-2	-	9M	10	-	
1*3Y	0	-	-1	-	1Y	10	-	
1*4Y	4	-	2	-1	2Y	10	-	
1*5Y	7	-1	7	-1	3Y	9	-	
2*3Y	2	-	1	-	4Y	8	-1	
2*4Y	6	-	4	-1	5Y	10	-	
2*5Y	9	-1	9	-1				
3*4Y	4	-	3	-1				
3*5Y	7	-1	8	-1				
4*5Y	3	-1	5	-				
5*7Y	12	1	7	3				
5*10Y	21	1	15	3				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	33	31	27	24	22	21
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	-1	31	10	41
今日	0	32	10	42



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting_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任何投资建议、投资建议或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