



【2023-08-14】

中国央行今日开展 60 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 30 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 30 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.85%，较上一交易日上升 7bp，3m shibor fixing: 2.0630%，较上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘开在 2.425%-2.4275%附近，之后下行至 2.4075%-2.405%后回升，回升至 2.415%后继续下行，上午在 2.3975%-2.425%附近震荡成交，午盘报收 40/39.75。午后，5y repo 小幅回升，成交在 2.39%-2.4175%附近。临近收盘，5y repo 下行至 2.395%-2.39%，报收 40/39.75。1y repo 早盘成交在 1.95%附近震荡，成交在 1.9475%-1.955%附近，午盘报收 95/94.25。下午 1y repo 成交在 1.9475%-1.9575%附近，尾盘报收 95/94.5。其他期限，6m repo 成交在 1.905%-1.9075%附近，2y repo 成交在 2.0475%-2.06%附近，3y repo 成交在 2.175%-2.185%附近。曲线方面，6mx1y repo spd 成交在 04.5-04.75bp 附近，1x2y repo spd 成交在 10-10.5bp 附近，3x5y repo spd 成交在 22.5bp，2x5y repo spd 成交在 35-35.5bp，1x5y repo spd 成交在 45.25-46bp，报收 45.25/45。

Shibor 端，5y shibor 报收 70/69.5，1y shibor 报收 14/13。其他期限，1x5y shibor spd 报收 56.5/55.5。Basis 方面，5y basis 报收 30/29.5，1y basis 报收 19.25/18.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

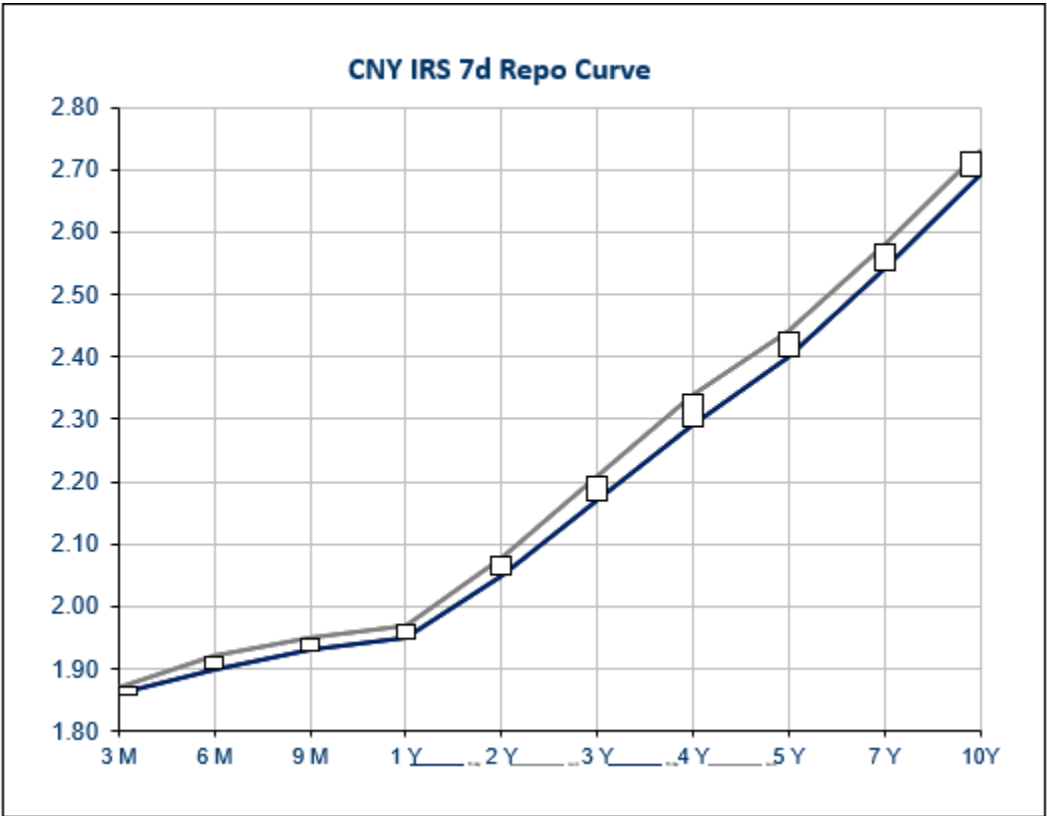
2023/8/14 Monday

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	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.86	-1				3 M	1.59	-						
6 M	1.9	-2	6 M	2.1	-2	6 M	1.51	-						
9 M	1.93	-2	9 M	2.11	-3	9 M	1.51	-						
1 Y	1.95	-2	1 Y	2.14	-2	1 Y	1.6	-				1Y	1.92	-3
2 Y	2.05	-3	2 Y	2.27	-3	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2	-4
3 Y	2.17	-4	3 Y	2.41	-4	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.12	-5
4 Y	2.29	-5	4 Y	2.56	-4				4 Y	1.8	-	4Y	2.24	-5
5 Y	2.4	-4	5 Y	2.7	-4				5 Y	1.8	-	5Y	2.33	-5
7 Y	2.54	-4	7 Y	2.86	-4				7 Y	1.8	-			
10Y	2.69	-4	10Y	2.96	-4				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.85	7.00	3M Shibor	2.063	-0.20	O-N Shibor	1.684	35.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO	SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	4 -1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	3 -	1	-1			
9M*1Y	2 -	3	1	6M	20	-
1*2Y	10 -1	13	-1	9M	18	-1
1*3Y	22 -2	27	-2	1Y	19	-
1*4Y	34 -3	42	-2	2Y	22	-
1*5Y	45 -2	56	-2	3Y	24	-
2*3Y	12 -1	14	-1	4Y	27	1
2*4Y	24 -2	29	-1	5Y	30	-
2*5Y	35 -1	43	-1			
3*4Y	12 -1	15	-			
3*5Y	23 -	29	-			
4*5Y	11 1	14	-			
5*7Y	14 -	16	-			
5*10Y	29 -	26	-			

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	-3	21	7	36
今日	-1	24	9	39



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报及更多资讯



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、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、时效性或准确性等要求。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

文 / Joyce Zhang