



【2024-08-27】

中国央行今日进行 4725 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.70%，与此前持平。因今日有 1491 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 3234 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 2.0%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 1.8490%，与上一交易日上升 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.84%附近，随后震荡成交在 1.8325%-1.845%区间附近，午盘报收 84.25/84。中午回来，5y repo 震荡上行，成交在 1.845%-1.8625%区间附近，报收 86/85.5。1y repo 全天震荡成交在 1.78%-1.755%区间附近，报收 77.75/77.25。其他期限，6m repo 成交在 1.8325%-1.835%区间附近，9m repo 成交在 1.7875%-1.79%区间附近，2y repo 成交在 1.745%附近，4y repo 成交在 1.805%区间附近。曲线方面，2x5y repo 成交在 09.75bp 点位，4x5y repo 成交在 03.75bp 点位，1x5y repo 成交在 07.25bp-08bp 区间附近，报收 08.25/08。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 88.75/87.25，5y shibor 成交在 1.955%附近，报收 96/95.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 08/06.75。基差方面，1y basis 报收 11/10，5y basis 报收 10/09.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

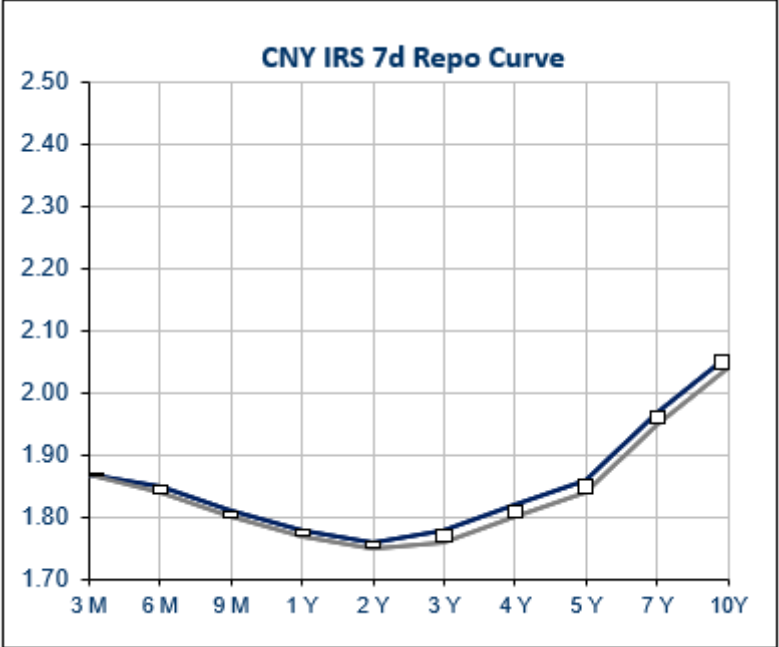
2024/8/27 Tuesday

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	1.87	-				3 M	1.71	1						
6 M	1.85	1	6 M	1.95	4	6 M	1.68	-						
9 M	1.81	1	9 M	1.91	3	9 M	1.66	1						
1 Y	1.78	1	1 Y	1.88	2	1 Y	1.65	-10				1Y	1.77	2
2 Y	1.76	1	2 Y	1.86	2	2 Y	1.64	1	2 Y	1.65	-	2Y	1.73	1
3 Y	1.78	2	3 Y	1.87	3	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.74	2
4 Y	1.82	2	4 Y	1.91	4				4 Y	1.8	-	4Y	1.78	2
5 Y	1.86	2	5 Y	1.96	5				5 Y	1.8	-	5Y	1.81	2
7 Y	1.97	2	7 Y	2	1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.06	2	10Y	2.08	2				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.00	-5.00	3M Shibor	1.849	0.40	0-N Shibor	1.667	-19.50	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	-	-4	-1			
9M*1Y	-3	-	-3	-1	6M	10	3
1*2Y	-2	-	-2	-	9M	10	2
1*3Y	0	1	-1	1	1Y	10	1
1*4Y	4	1	3	2	2Y	10	1
1*5Y	8	1	8	3	3Y	9	1
2*3Y	2	1	1	1	4Y	9	2
2*4Y	6	1	5	2	5Y	10	3
2*5Y	10	1	10	3			
3*4Y	4	-	4	1			
3*5Y	8	-	9	2			
4*5Y	4	-	5	1			
5*7Y	11	-	4	-4			
5*10Y	20	-	12	-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	-2	30	9	40
今日	-1	31	10	41



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiating.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, 且为保密的或/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。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang
禁止处理涉密信息和内部敏感信息