



【2023-08-16】

中国央行今日进行 2990 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，此前为 1.8%。今日有 20 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 2.0400%，与上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.335%附近，后稍微震荡上行，成交在 2.335%-2.35%区间附近，午盘报收 34.75/34.5。中午回来，5y repo 成交在 2.345%附近，后稍微震荡下行，成交在 2.345%-2.335%区间附近，尾盘稍微回调，成交到 2.34%附近，尾盘报收 34.25/34。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.905%-1.9175%区间附近，尾盘报收 91.5/91.25。其他期限，2y repo 成交在 1.99%-2.01%区间附近。曲线方面，2x5y repo 成交在 33.25bp 附近，1x5y repo 成交在 42.75bp 附近，报收 43/42.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.09%-2.0925%附近，报收 09.75/09.5，2y shibor 成交在 2.2075%附近，5y shibor 成交在 2.64%-2.6475%附近，报收 63.75/63.5。曲线方面，1x2 shibor 成交在 11.5bp 附近，2x5 shibor 成交在 43.25bp 附近，1x5 shibor 报收 54.25/53.75。基差方面，2y basis 成交在 20bp 附近，1y basis 报收 18.5/18，5y basi 成交在 29-29.5bp 附近，报收 29.5/29.25。

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

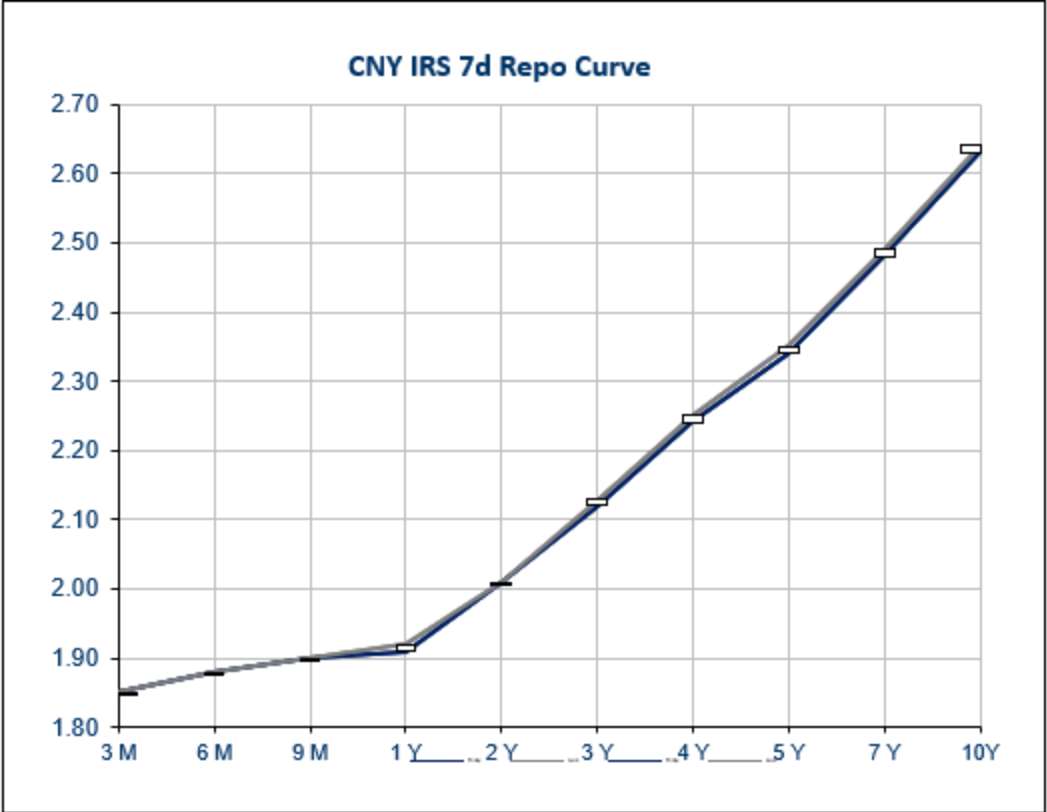
2023/8/16 Wednesday

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	1.85	-				3 M	1.59	-5									
6 M	1.88	-	6 M	2.07	-	6 M	1.52	-4									
9 M	1.9	-	9 M	2.07	-1	9 M	1.52	-4									
1 Y	1.91	-1	1 Y	2.09	-1	1 Y	1.53	-2				1Y	1.88	-1			
2 Y	2.01	-	2 Y	2.21	-1	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.96	-1			
3 Y	2.12	-1	3 Y	2.35	-1	3 Y	1.95	-5	3 Y	1.77	-	3Y	2.07	-2			
4 Y	2.24	-1	4 Y	2.5	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.18	-2			
5 Y	2.34	-1	5 Y	2.63	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.26	-2			
7 Y	2.48	-1	7 Y	2.8	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.63	-1	10Y	2.9	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.90	-3.00	3M Shibor	2.04	-0.50	O-N Shibor	1.833	6.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	3	-			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	2	-	0	-1			
9M*1Y	1	-1	2	-	6M	19	-
1*2Y	10	1	12	-	9M	17	-1
1*3Y	21	-	26	-	1Y	18	-
1*4Y	33	-	41	1	2Y	20	-1
1*5Y	43	-	54	-	3Y	23	-
2*3Y	11	-1	14	-	4Y	26	1
2*4Y	23	-1	29	1	5Y	29	-
2*5Y	33	-1	42	-			
3*4Y	12	-	15	1			
3*5Y	22	-	28	-			
4*5Y	10	-	13	-1			
5*7Y	14	-	17	1			
5*10Y	29	-	27	1			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	51	51	48	48	49	50	51
今日	51	51	48	48	49	50	51

Bond Swap	230015/5y repo	230012/5y repo	230203/5y repo	230210/5y repo
昨日	-3	18	6	40
今日	2	22	11	34



联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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、投资策略任何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, 所有前述和保证均经特此免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang