



【2024-08-15】

中国央行今日进行逆回购：5777 亿，中标利率为 1.70%，与此前持平。因今日逆回购到期 71 亿，今日到期的 MLF 将于 8 月 26 日续做，当日实现净投放 1696 亿元。资金面上午偏紧，下午转均衡。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.8400%，与上一交易日上升 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.8275%附近，后小幅震荡成交在 1.82%-1.84%区间附近，午盘报收 83.75/83.5。中午回来，5y repo 震荡上行，成交在 1.835%-1.855%区间附近，报收 85/84.75。1y repo 早盘成交在 1.735%-1.7625%区间附近，报收 76.25/76。其他期限，2y repo 成交在 1.745%-1.74%,9m repo 成交在 1.775%,6m repo 成交在 1.8125%-1.81%。曲线方面，6x9 repo 成交在再-3.5bp 点位，9x1 repo 成交在-2.5bp 点位，1x2y repo 成交在-01.5bp 点位，2x5y repo 成交在 10.5bp 点位，1x5y repo 成交在 9bp-8.75bp 区间附近。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 85.25/84.5，5y shibor 报收 92/91.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 7.25/6.5。基差方面，1y basis 报收 9.25/8.75，5y basis 报收 7.5/7。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

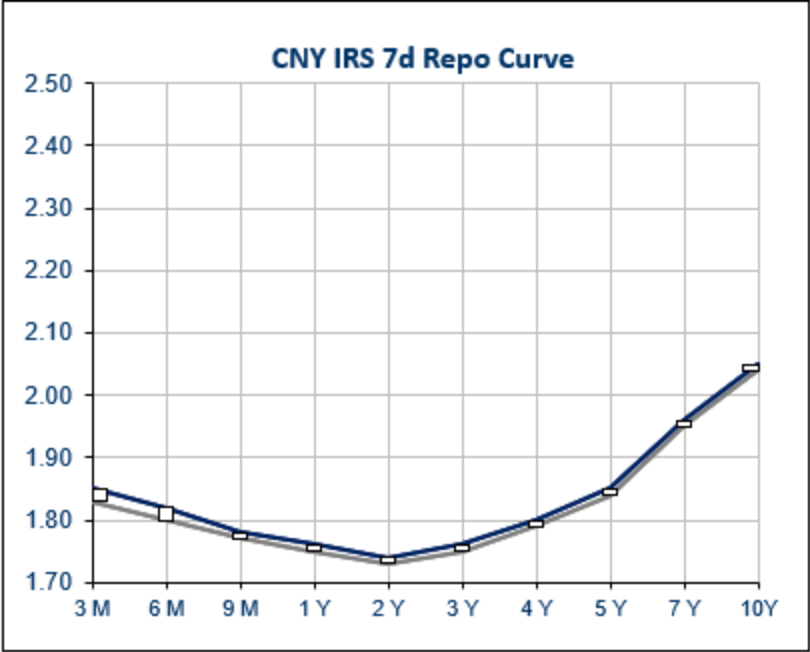
2024/8/15 Thursday

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	1.69	-1									
6 M	1.82	2	6 M	1.91	2	6 M	1.66	-1									
9 M	1.78	1	9 M	1.88	2	9 M	1.67	-8									
1 Y	1.76	1	1 Y	1.85	1	1 Y	1.75	-				1Y	1.74	-			
2 Y	1.74	1	2 Y	1.83	1	2 Y	1.63	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.71	-			
3 Y	1.76	1	3 Y	1.83	2	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.72	-			
4 Y	1.8	1	4 Y	1.87	2				4 Y	1.8	-	4Y	1.76	-			
5 Y	1.85	1	5 Y	1.92	2				5 Y	1.8	-	5Y	1.8	1			
7 Y	1.96	1	7 Y	2	1				7 Y	1.8	-						
10Y	2.05	1	10Y	2.08	1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.90	-2.00	3M Shibor	1.84	0.20	0-N Shibor	1.754	-8.80	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	-1	-3	-				
9M*1Y	-2	-	-3	-1	6M	9	-	
1*2Y	-2	-	-2	-	9M	10	1	
1*3Y	0	-	-2	1	1Y	9	-	
1*4Y	4	-	2	1	2Y	9	-	
1*5Y	9	-	7	1	3Y	7	1	
2*3Y	2	-	0	1	4Y	7	1	
2*4Y	6	-	4	1	5Y	7	1	
2*5Y	11	-	9	1				
3*4Y	4	-	4	-				
3*5Y	9	-	9	-				
4*5Y	5	-	5	-				
5*7Y	11	-	8	-1				
5*10Y	20	-	16	-1				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	34	33	27	25	23	22
今日	36	34	33	27	25	23	22

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	1	32	7	36
今日	4	32	11	40



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任何金融工具、投资建议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, 所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang