



【2024-08-26】

中国央行今日进行 4710 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 521 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 4189 亿元。资金面上午偏紧，下午转均衡。此外，中国央行今日进行 3000 亿元 1 年期 MLF 操作，中标利率为 2.30%，与此前持平。7d repo fixing: 2.05%，与上一交易日上升 13bp，3m shibor fixing: 1.8450%，与上一交易日上升 0.1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.8275%附近，随后震荡成交在 1.835%-1.8225%区间附近，午盘报收 82.75/82.5。中午回来，5y repo 震荡维持小幅震荡，成交在 1.8325%-1.8275%区间附近，报收 83.75/83.5。1y repo 全天震荡成交在 1.7775%-1.7425%区间附近，报收 76.75/76.25。其他期限，2y repo 成交在 1.74%-1.7425%附近，3y repo 成交在 1.765%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在-1.5bp 到-1.75bp 点位，1x5y repo 成交在 06-07bp 区间附近，报收 07.25/06.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 成交在 1.865%附近，报收 86.25/86，5y shibor 成交在 1.90%-1.91%，附近报收 92/91.25。曲线方面，1x5y shibor 成交在 04.5bp 附近，报收 05.5/04.75。基差方面，1y basis 成交在 10bp 附近，报收 10/09.5，5y basis 成交在 07.75bp 附近，报收 08.25/07.75。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

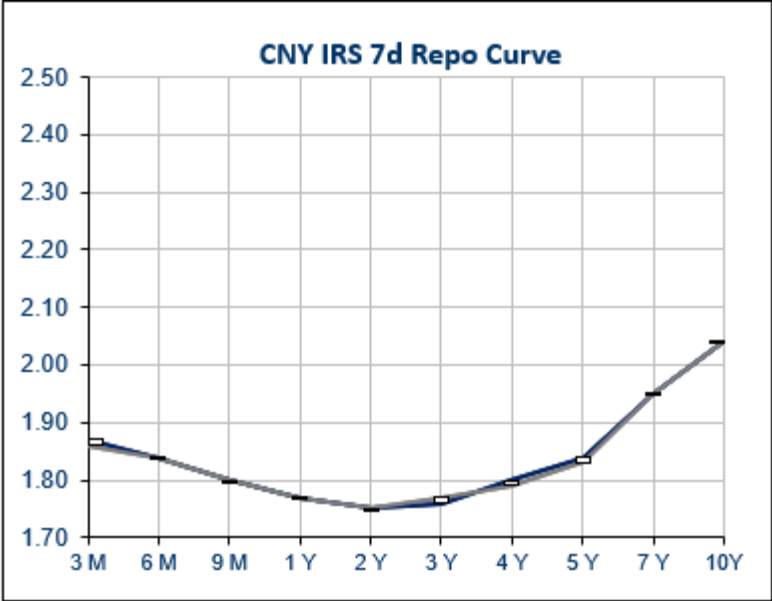
2024/8/26 Monday

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	1				3 M	1.7	-						
6 M	1.84	-	6 M	1.91	-2	6 M	1.68	-1						
9 M	1.8	-	9 M	1.88	-2	9 M	1.65	-						
1 Y	1.77	-	1 Y	1.86	-	1 Y	1.75	10				1Y	1.75	-1
2 Y	1.75	-	2 Y	1.84	1	2 Y	1.63	-1	2 Y	1.65	-	2Y	1.72	-
3 Y	1.76	-1	3 Y	1.84	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.72	-1
4 Y	1.8	1	4 Y	1.87	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.76	-1
5 Y	1.84	1	5 Y	1.91	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.79	-
7 Y	1.95	-	7 Y	1.99	1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.04	-	10Y	2.06	1				10Y	1.8	-			
7D REPO	2.05	13.00	3M Shibor	1.845	0.10	0-N Shibor	1.862	6.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-3	-1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	-	-3	-				
9M*1Y	-3	-	-2	2	6M	7	-2	
1*2Y	-2	-	-2	1	9M	8	-2	
1*3Y	-1	-1	-2	-	1Y	9	-	
1*4Y	3	1	1	-	2Y	9	1	
1*5Y	7	1	5	-	3Y	8	1	
2*3Y	1	-1	0	-1	4Y	7	-1	
2*4Y	5	1	3	-1	5Y	7	-1	
2*5Y	9	1	7	-1				
3*4Y	4	2	3	-				
3*5Y	8	2	7	-				
4*5Y	4	-	4	-				
5*7Y	11	-1	8	1				
5*10Y	20	-1	15	1				

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	30	9	40
今日	-2	30	9	40



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:
以上所发及附发的所有信息 (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新证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国新证券”) 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、建议或诱导。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其所提供、控制性或者及时性等要求, 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