



【2023-08-17】

中国央行今日开展 1680 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 50 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 1630 亿元，资金面均衡偏紧。7d repo fixing:1.95%，与上一交易日相比上升 5bp，3m shibor fixing: 2.03%，与上一交易日下降 1bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.3375%-2.34%附近，随国债期货震荡下行，5y repo 有所上行，成交在 2.3450%-2.355%，午盘报收 35.75/35.5。午后 5y repo gvn 至 2.3625%后下行成交在 2.36%-2.34%，尾盘报收 34.5/34.25。1y repo 随长端变化成交在 1.925%-1.9025%，尾盘报收 90.5/90.25。其他期限，9m repo 成交在 1.89%附近，2y repo 成交在 2.01%-2.015%附近。曲线方面，9mx1y repo spd 成交 1.5bp-1.75bp 附近，1x2 repo spd 成交在 9.75bp-10bp，1x5y repo spd 成交在 43.25bp-43.75bp，报收 44/43.75。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.08%-2.095%，报收 9.25/8.5，2y shibor 成交在 2.21%-2.225%，报收 21.25/20，5y shibor 成交在 2.64%-2.66%，报收 64.25/63.75。曲线方面，1x2y shibor spd 成交在 11.5bp-12.25bp 附近，2x5 shibor spd 成交在 43bp 附近，1x5 shibor spd 成交在 54.5bp 附近。基差方面，1y basis 报收 18.75/18，5y basis 报收 29.75/29.5。

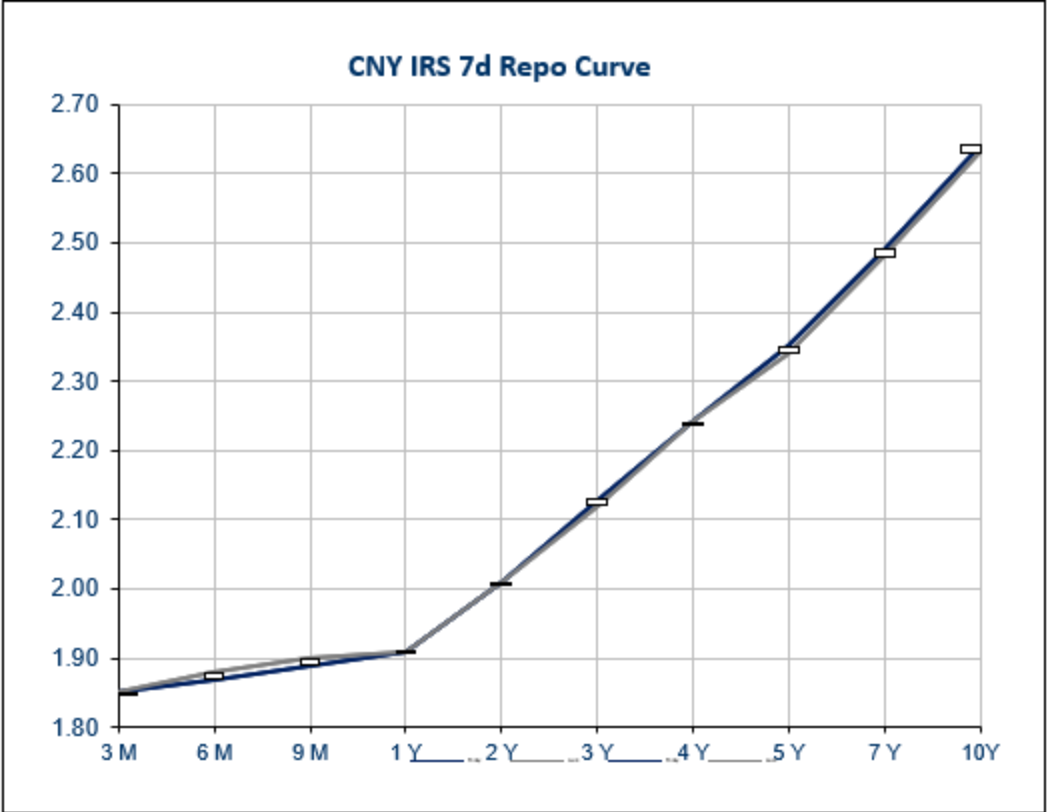
其他方面，报价寥寥，未闻成交。
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/8/17 Thursday

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	1.54	-5									
6 M	1.87	-1	6 M	2.07	-	6 M	1.51	-1									
9 M	1.89	-1	9 M	2.07	-	9 M	1.52	-									
1 Y	1.91	-	1 Y	2.09	-	1 Y	1.53	-				1Y	1.88	-			
2 Y	2.01	-	2 Y	2.21	-	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.96	-			
3 Y	2.13	1	3 Y	2.35	-	3 Y	1.95	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.07	-			
4 Y	2.24	-	4 Y	2.5	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.18	-			
5 Y	2.35	1	5 Y	2.64	1				5 Y	1.8	-	5Y	2.28	2			
7 Y	2.49	1	7 Y	2.81	1				7 Y	1.8	-						
10Y	2.64	1	10Y	2.91	1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.95	5.00	3M Shibor	2.03	-1.00	O-N Shibor	1.842	0.90	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	2	-1			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	2	-	0	-			
9M*1Y	2	1	2	-	6M	20	1
1*2Y	10	-	12	-	9M	18	1
1*3Y	22	1	26	-	1Y	18	-
1*4Y	33	-	41	-	2Y	20	-
1*5Y	44	1	55	1	3Y	22	-
2*3Y	12	1	14	-	4Y	26	-
2*4Y	23	-	29	-	5Y	29	-
2*5Y	34	1	43	1			
3*4Y	11	-1	15	-			
3*5Y	22	-	29	1			
4*5Y	11	1	14	1			
5*7Y	14	-	17	-			
5*10Y	29	-	27	-			

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	2	22	11	34			
今日	2	22	11	34			



文 / Joyce Zhang

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:
以上所述及列出的所有信息 (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际货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际货币”) 或某三方。“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