



【2023-08-10】

中国央行今日开展 50 亿元逆回购操作，因今日有 30 亿元逆回购到期，当日实现净投放 20 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.78%，与上一交易日相比下降 2bp，3m shibor fixing: 2.0670%，与上一交易日下降 0.7bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.455%附近，国债期货下行后略微回调，5y repo 先上行成交在 2.4575%-2.465%区间附近后下行震荡在 2.4625%-2.46%，午盘报收 46.25/46。中午回来，5y repo 成交在 2.46%附近，后稍微震荡下行，成交在 2.46%-2.455%区间附近，尾盘报收 46/45.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.995%-1.985%区间附近，尾盘报收 98.75/95.5。其他期限，3m repo 成交在 1.9025%-1.895%附近，6m repo 成交在 1.945%-1.94%附近，9m repo 成交在 1.9625%附近，2y repo 成交在 2.105%-2.0975%附近，3y repo 成交在 2.23%-2.2275%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在 0.45bp-04.25bp 附近，3mx9m repo 成交 6.75bp 附近，6mx1y repo 成交 4.75bp 附近，1x2y repo 成交在 11bp 附近，2x3y repo 成交在 13bp 附近，2x5y repo 成交在 36bp 附近，3x5y repo 成交在 23bp 附近，1x5y repo 成交在 46.75-47.25bp 附近，报收 47.5/47。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 17.5/17，5y shibor 报收 76.25/75.25。基差方面，1y basis 报收 19/18.5，5y basis 报收 30.25/29.75。

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

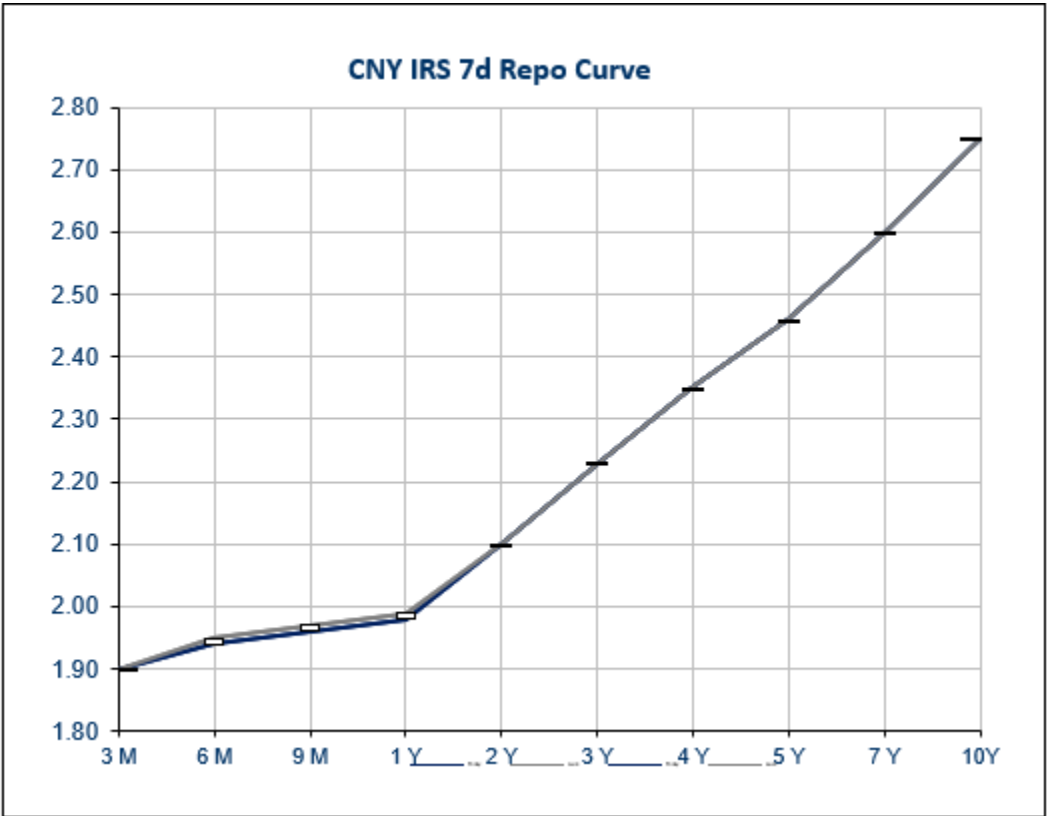
2023/8/10 Thursday

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	1.9	-				3 M	1.59	-						
6 M	1.94	-1	6 M	2.13	-	6 M	1.51	-						
9 M	1.96	-1	9 M	2.15	-1	9 M	1.51	-						
1 Y	1.98	-1	1 Y	2.17	-1	1 Y	1.6	-				1Y	1.97	-
2 Y	2.1	-	2 Y	2.31	-1	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.06	-1
3 Y	2.23	-	3 Y	2.46	-	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.19	-1
4 Y	2.35	-	4 Y	2.61	-				4 Y	1.8	-	4Y	2.31	-1
5 Y	2.46	-	5 Y	2.76	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.41	-
7 Y	2.6	-	7 Y	2.93	-				7 Y	1.8	-			
10Y	2.75	-	10Y	3.03	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.80	-	3M Shibor	2.067	-0.70	O-N Shibor	1.34	-20.10	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	4	-1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	2	-	2	-1			
9M*1Y	2	-	2	-	6M	19	1
1*2Y	12	1	14	-	9M	19	-
1*3Y	25	1	29	1	1Y	19	-
1*4Y	37	1	44	1	2Y	21	-1
1*5Y	48	1	59	1	3Y	23	-
2*3Y	13	-	15	1	4Y	26	-
2*4Y	25	-	30	1	5Y	30	-
2*5Y	36	-	45	1			
3*4Y	12	-	15	-			
3*5Y	23	-	30	-			
4*5Y	11	-	15	-			
5*7Y	14	-	17	-			
5*10Y	29	-	27	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	58	57	56	56	57	59	60
今日	58	57	56	56	57	59	60

Bond Swap	230002/5y repo	230004/5y repo	230203/5y repo	230205/5y repo
昨日	-5	21	6	35
今日	-4	20	7	35



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:
以上所述及附加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/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、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、时效性或准确性等要求, 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