



【2023-08-08】

 中国人民银行今日开展 60 亿元逆回购操作，因今日有 80 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 20 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.80%，较上一交易日上升 8bp，3m shibor fixing: 2.075%，较上一交易日下降 0.5bp。

 Repo 端，早盘，5y repo 开在 2.4625%后窄幅震荡在 2.4625%-2.465%，随着国债期货下行，5y repo 逐步上行成交在 2.465%-2.47%，午盘报收 46.75/46.5。午后，国债期货回升，5y repo 一路下行 gvn 至 2.46%，期货收盘后，5y repo 跳水 gvn 至 2.45%后略微回升成交在 2.4525%-2.455%，报收 45.5/45.25。1y repo 早盘开在 1.985%附近后窄幅震荡在 1.985%-1.9825%。随国债期货变化，1y repo tkn 至 1.9925%，午盘报收 99.25/99。午后，1y repo 下行成交在 1.9875%-1.98%附近，报收 98.25/98。其他期限，2y repo 成交 2.105%-2.0925%附近，曲线方面，1x2y repo spd 成交 1.25bp 附近，2x5y repo spd 成交 36.25bp 附近，1x5y repo spd 成交在 48-47.75bp 附近，报收 47.2547。

 Shibor 端，5y shibor 报收 75.75/75，1y shibor 成交在 2.1875%-2.175%附近，报收 18/17.5。曲线方面，6mx9m shibor spd 成交在 03bp，1x5y shibor spd 报收 58.25/57.25。Basis 方面，5y basis 报收 30.25/29.75，1y basis 报收 19.5/19。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

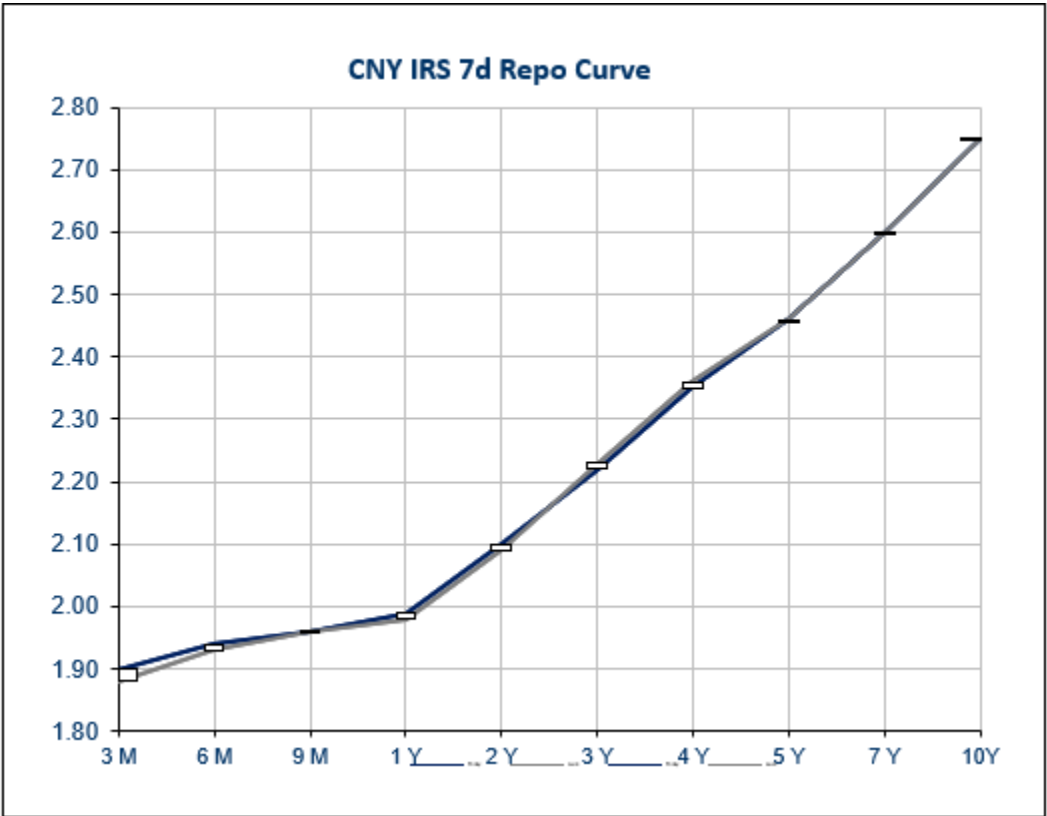
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/8/8 Tuesday

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	2				3 M	1.59	-									
6 M	1.94	1	6 M	2.12	-	6 M	1.51	-									
9 M	1.96	-	9 M	2.15	-	9 M	1.51	-									
1 Y	1.99	1	1 Y	2.18	-	1 Y	1.6	-				1Y	1.97	-			
2 Y	2.1	1	2 Y	2.31	-	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.06	-			
3 Y	2.22	-1	3 Y	2.46	-	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.19	-1			
4 Y	2.35	-1	4 Y	2.61	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.31	-1			
5 Y	2.46	-	5 Y	2.76	-				5 Y	1.8	-	5Y	2.41	-1			
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	8.00	3M Shibor	2.075	-0.50	O-N Shibor	1.361	-15.70	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	4 -1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	2 -1	3 -				
9M*1Y	3 1	3 -	6M	18	-1	
1*2Y	11 -	13 -	9M	19		-
1*3Y	23 -2	28 -	1Y	19	-1	
1*4Y	36 -2	43 -1	2Y	21	-1	
1*5Y	47 -1	58 -	3Y	24		-
2*3Y	12 -2	15 -	4Y	26		-
2*4Y	25 -2	30 -1	5Y	30		-
2*5Y	36 -1	45 -				
3*4Y	13 -	15 -1				
3*5Y	24 1	30 -				
4*5Y	11 1	15 1				
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	-4	20	6	36			
今日	-4	21	6	35			



联系人: Ruby Hu
邮箱: ruby.hu@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:
以上所登及附登的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 且为保密的、或者专用的信息, 其知识仅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、股票或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, 且可能随时被撤销或修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang