



【2024-08-16】

中国央行今日进行 1378 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率持平 1.7%。今日有 129 亿元逆回购到期。中国央行本周共开展 15449 亿元逆回购操作，实现净投放 11226.1 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing：1.86%，与上一交易日下降 4bp，3m shibor fixing: 1.8380%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.84%附近，后小幅震荡下行，成交在 1.84%-1.825%附近，午盘报收 83/82.75。中午回来，5y repo 震荡回调，成交在 1.8275%-1.8425%区间附近，报收 84.25/84。1y repo 全天震荡成交在 1.7425%-1.76%区间附近，报收 76 /75.75。其他期限，6m repo 成交 1.825%-1.8275%附近，9m repo 成交在 1.7875%附近，2y repo 成交在 1.73%-1.74%区间附近，3y repo 成交在 1.7375%附近，4y repo 成交在 1.8025%-1.7925%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交-1.5bp 附近，2x5y repo 成交在 10-9.75bp 附近，1x3x4y repo fly 成交在-3.25bp 附近，1x5y repo 成交在 8.75-8.5bp 附近，报收 08.75/08.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 84.75/83.25，5y shibor 成交在 1.9075%附近，报收 91/90。曲线方面，1x5y shibor 报收 07.5/06。基差方面，1y basis 报收 08.75/07.5，5y basis 成交在 6.75bp 附近，报收 6.75/6.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

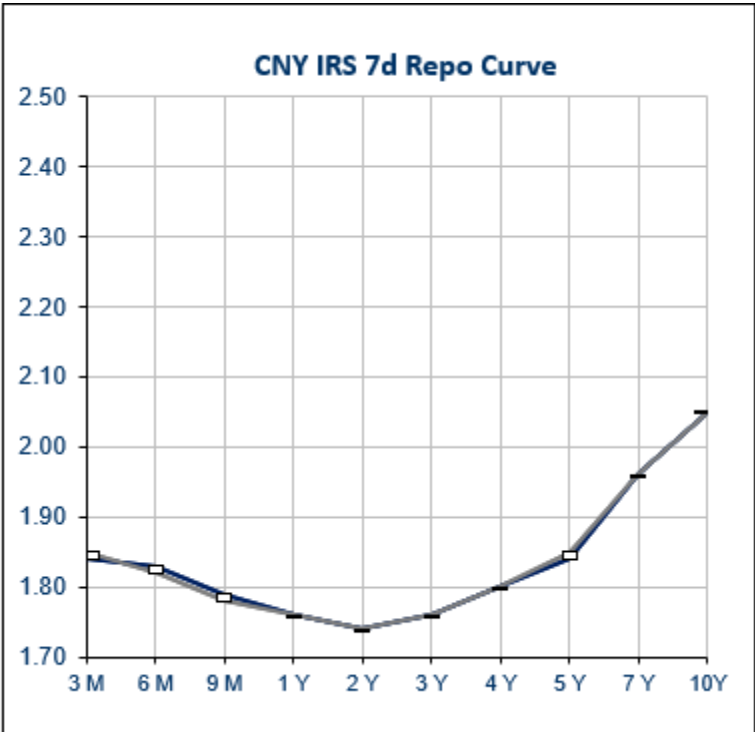
2024/8/16 Friday

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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1.84	-1				3 M	1.75	6									
6 M	1.83	1	6 M	1.92	1	6 M	1.68	2									
9 M	1.79	1	9 M	1.87	-1	9 M	1.75	8									
1 Y	1.76	-	1 Y	1.84	-1	1 Y	1.75	-				1Y	1.74	-			
2 Y	1.74	-	2 Y	1.81	-2	2 Y	1.62	-1	2 Y	1.65	-	2Y	1.71	-			
3 Y	1.76	-	3 Y	1.82	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.72	-			
4 Y	1.8	-	4 Y	1.86	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.76	-			
5 Y	1.84	-1	5 Y	1.91	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.8	-			
7 Y	1.96	-	7 Y	2	-				7 Y	1.8	-						
10Y	2.05	-	10Y	2.08	-				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.86	-4.00	3M Shibor	1.838	-0.20	O-N Shibor	1.70	-5.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
					Tenor	Mid	Δbp	
3M*6M	-1	2						
6M*9M	-4	-	-5	-2				
9M*1Y	-3	-1	-3	-	6M	9	-	
1*2Y	-2	-	-3	-1	9M	8	-2	
1*3Y	0	-	-2	-	1Y	8	-1	
1*4Y	4	-	2	-	2Y	7	-2	
1*5Y	8	-1	7	-	3Y	6	-1	
2*3Y	2	-	1	1	4Y	6	-1	
2*4Y	6	-	5	1	5Y	7	-	
2*5Y	10	-1	10	1				
3*4Y	4	-	4	-				
3*5Y	8	-1	9	-				
4*5Y	4	-1	5	-				
5*7Y	12	1	9	1				
5*10Y	21	1	17	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	4	32	11	40
今日	3	31	10	39



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:
以上所发及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或者有别的意图, 其知识产权属于上海国际货币经纪有限公司 (以下简称“上海国际货币”) 或其三方。“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推介、定价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、时效性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang