



【2024-08-21】

中国央行今日进行 2580 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 3692 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1112 亿元。资金面全天偏紧。7d repo fixing：1.88%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 1.84%，与上一交易日上升 0.2bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.8275 %附近，后震荡上行成交在 1.8275 %-1.845%区间附近，午盘报收 85/84.75。中午回来，5y repo 震荡下行成交在 1.8575%-1.8275%区间附近，报收 83.25/82.75。1y repo 早盘成交 1.765%，后全天震荡成交在 1.7975%-1.765%区间附近，报收 77.5/77。其他期限，3m repo 成交在 1.88%区间附近，9m repo 成交在 1.815%-1.805%区间附近，2y repo 成交在 1.76%区间附近，3y repo 成交在 1.77%。曲线方面，9mx1y repo 成交在 -03bp 到 -02.75bp 附近，3x5y repo 成交在 07.5bp 附近，1x5y repo 成交在 06.5bp 到 06bp 区间附近，1x5y repo 报收 06.5/05.5。

Shibor 端，6m shibor 成交在 1.94%附近，1y shibor 成交在 1.8875%-1.87%区间附近，报收 86.5/85.25。1x5y shibor 报收 4.75/4。基差方面，1y basis 报收 09.5/08.25，5y basis 报收 07.75/07.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

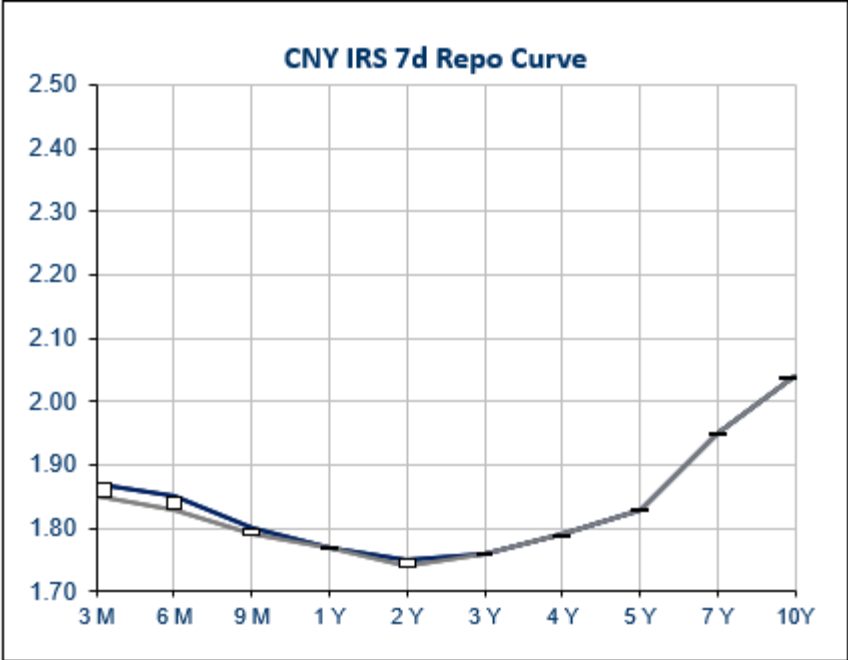
2024/8/21 Wednesday

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	2				3 M	1. 7	1						
6 M	1. 85	2	6 M	1. 92	–	6 M	1. 67	–						
9 M	1. 8	1	9 M	1. 89	–	9 M	1. 66	1						
1 Y	1. 77	–	1 Y	1. 86	1	1 Y	1. 65	2				1Y	1. 76	1
2 Y	1. 75	1	2 Y	1. 83	1	2 Y	1. 63	–	2 Y	1. 65	–	2Y	1. 72	1
3 Y	1. 76	–	3 Y	1. 83	1	3 Y	1. 75	–	3 Y	1. 77	–	3Y	1. 72	–
4 Y	1. 79	–	4 Y	1. 86	–				4 Y	1. 8	–	4Y	1. 76	–
5 Y	1. 83	–	5 Y	1. 9	–				5 Y	1. 8	–	5Y	1. 79	–
7 Y	1. 95	–	7 Y	1. 98	–				7 Y	1. 8	–			
10Y	2. 04	–	10Y	2. 07	–				10Y	1. 8	–			
7D REPO	1. 88	2. 00	3M Shibor	1. 84	0. 20	0-N Shibor	1. 722	1. 00	1Y DEPO	1. 50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	–2	–			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	–5	–1	–3	–				
9M*1Y	–3	–1	–3	1	6M	7	–2	
1*2Y	–2	1	–3	–	9M	9	–1	
1*3Y	–1	–	–3	–	1Y	9	1	
1*4Y	2	–	0	–1	2Y	8	–	
1*5Y	6	–	4	–1	3Y	7	1	
2*3Y	1	–1	0	–	4Y	7	–	
2*4Y	4	–1	3	–1	5Y	7	–	
2*5Y	8	–1	7	–1				
3*4Y	3	–	3	–1				
3*5Y	7	–	7	–1				
4*5Y	4	–	4	–				
5*7Y	12	–	8	–				
5*10Y	21	–	17	–				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	36	33	32	27	25	23	22
今日	36	33	32	27	25	23	22

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	4	32	12	40
今日	3	31	11	40



联系人: Ruby Hu
邮箱: viaoting.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:
以上所述及所加的所有信息 (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。其知识产仅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、投资策略或任何交易策略相关的推介、定价、建议或建议。“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, 所有陈述和保证均被明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang