



【2024-08-22】

中国央行今日进行 3593 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率持平 1.7%。今日有 5777 亿元逆回购到期。资金面整体偏紧，尾盘转松。7d repo fixing：1.91%，与上一交易日上升 3bp，3m shibor fixing: 1.843%，与上一交易日上升 0.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.83%附近，后小幅震荡，成交在 1.825%-1.8375%区间附近，午盘报收 83/82.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.825%-1.835%区间附近，报收 83.25/83。1y repo 全天震荡成交在 1.7725%-1.79%区间附近，报收 78.5/78.25。其他期限，3m repo 成交在 1.865%-1.87%区间附近，6m repo 成交在 1.8575%附近，9m repo 成交在 1.8125%-1.8225%区间附近，2y repo 成交在 1.75%附近，4y repo 成交在 1.785%-1.79%区间附近。曲线方面，9mx4y repo 成交在-3bp 附近，4x5y repo 成交在 4bp 附近，1x5y repo 成交在 5.75-4.5bp 附近，曲线走平，报收 04.75/04.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 87.5/87，5y shibor 报收 91.25/90.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 4.25/3.75。基差方面，1y basis 报收 09/08.5，5y basis 报收 08/07.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

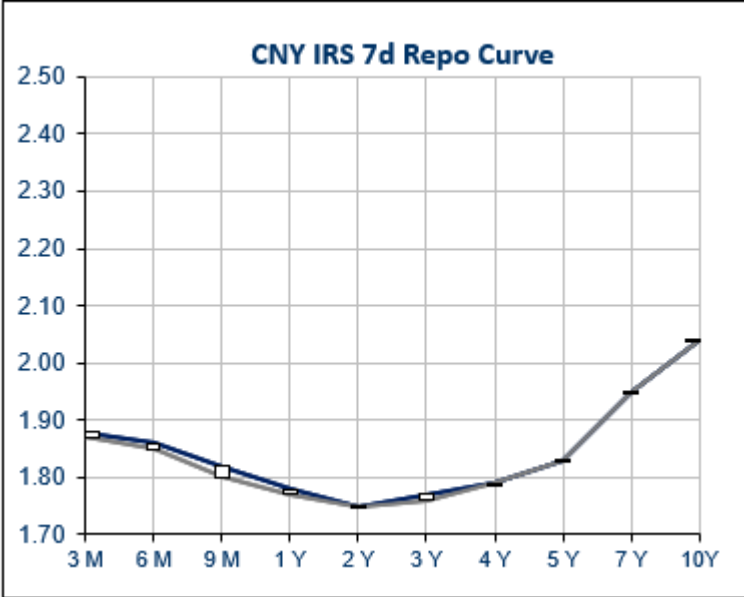
2024/8/22 Thursday

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	1.88	1				3 M	1.71	1									
6 M	1.86	1	6 M	1.92	-	6 M	1.69	2									
9 M	1.82	2	9 M	1.9	1	9 M	1.66	-									
1 Y	1.78	1	1 Y	1.87	1	1 Y	1.65	-				1Y	1.77	1			
2 Y	1.75	-	2 Y	1.84	1	2 Y	1.63	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.73	1			
3 Y	1.77	1	3 Y	1.84	1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.73	1			
4 Y	1.79	-	4 Y	1.87	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.77	1			
5 Y	1.83	-	5 Y	1.91	1				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	1.91	3.00	3M Shibor	1.843	0.30	0-N Shibor	1.765	4.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	1	-2	1				
9M*1Y	-4	-1	-3	-	6M	6	-1	
1*2Y	-3	-1	-3	-	9M	8	-1	
1*3Y	-1	-	-3	-	1Y	9	-	
1*4Y	1	-1	0	-	2Y	9	1	
1*5Y	5	-1	4	-	3Y	7	-	
2*3Y	2	1	0	-	4Y	8	1	
2*4Y	4	-	3	-	5Y	8	1	
2*5Y	8	-	7	-				
3*4Y	2	-1	3	-				
3*5Y	6	-1	7	-				
4*5Y	4	-	4	-				
5*7Y	12	-	7	-1				
5*10Y	21	-	16	-1				

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	3	31	11	40
今日	2	31	11	40



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:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 并非投资建议/或者专业的信息, 其知识仅限于上海国脉货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国脉货币”) 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, 也不保证其真实性、及时性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改, 所有前述和保证均按初始免责声明声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang