



【2024-08-13】

中国央行今日进行 3857 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 6.2 亿元逆回购到期，当日实现净投放 3850.8 亿元。资金面上午偏紧，下午转均衡。7d repo fixing: 1.95%，与上一交易日上升 3bp，3m shibor fixing: 1.8370%，与上一交易日上升 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.8875%附近，后震荡成交在 1.8925%-1.86%区间附近，午盘报收 86/85.5。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.87%-1.8475%区间附近，报收 84.25/83.5。1y repo 全天震荡成交在 1.785%-1.755%区间附近，报收 75.75/75。其他期限，2y repo 成交在 1.755%-1.765%，3y repo 成交在 1.775%-1.785%区间附近，4y repo 成交在 1.8075%-1.8125%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在-00.75bp 点位，4x5y repo 成交在 4.75bp 点位，2x5y repo 成交在 10.5-11bp 区间附近，1x5y repo 成交在 9.75bp 点位，报收 9.25/8.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 84.5/83，3y shibor 成交在 1.855%附近，5y shibor 报收 91/90.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 08/06.5。基差方面，1y basis 报收 09/08，5y basis 报收 06.75/06。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

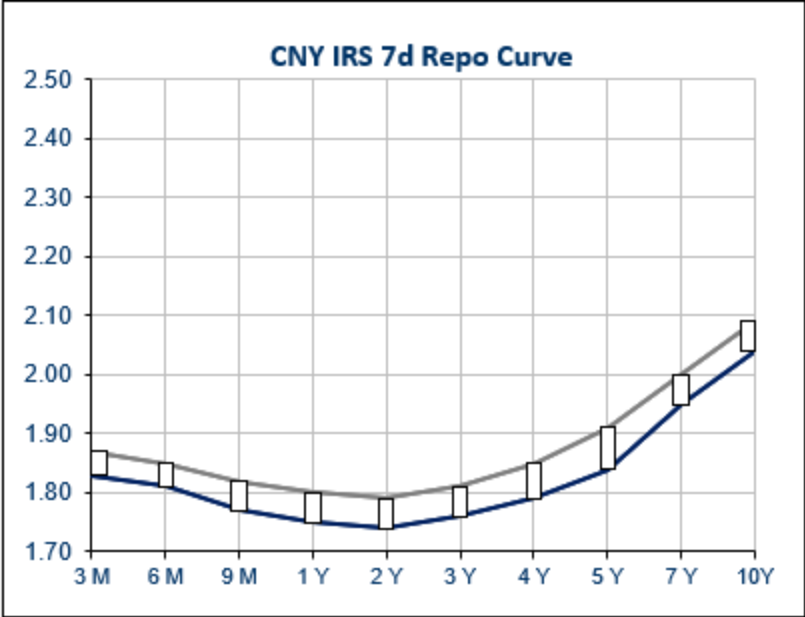
2024/8/13 Tuesday

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	1.83	-4				3 M	1.7	-1									
6 M	1.81	-4	6 M	1.89	-3	6 M	1.67	-1									
9 M	1.77	-5	9 M	1.86	-3	9 M	1.75	8									
1 Y	1.75	-5	1 Y	1.84	-4	1 Y	1.75	-				1Y	1.75	-3			
2 Y	1.74	-5	2 Y	1.81	-5	2 Y	1.63	-2	2 Y	1.65	-	2Y	1.71	-4			
3 Y	1.76	-5	3 Y	1.81	-7	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.73	-4			
4 Y	1.79	-6	4 Y	1.85	-7				4 Y	1.8	-	4Y	1.76	-4			
5 Y	1.84	-7	5 Y	1.9	-7				5 Y	1.8	-	5Y	1.81	-4			
7 Y	1.95	-5	7 Y	1.99	-6				7 Y	1.8	-						
10Y	2.04	-5	10Y	2.07	-7				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.95	3.00	3M Shibor	1.837	0.40	0-N Shibor	1.928	-2.30	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-2	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-4	-1	-3	-				
9M*1Y	-2	-	-2	-1	6M	8	1	
1*2Y	-1	-	-3	-1	9M	9	2	
1*3Y	1	-	-3	-3	1Y	9	1	
1*4Y	4	-1	1	-3	2Y	7	-	
1*5Y	9	-2	6	-3	3Y	5	-2	
2*3Y	2	-	0	-2	4Y	6	-1	
2*4Y	5	-1	4	-2	5Y	6	-	
2*5Y	10	-2	9	-2				
3*4Y	3	-1	4	-				
3*5Y	8	-2	9	-				
4*5Y	5	-1	5	-				
5*7Y	11	2	9	1				
5*10Y	20	2	17	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	37	34	33	27	25	23	22
今日	37	34	33	27	25	23	22

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	1	32	8	38
今日	3	35	10	40



联系人: Ruby Hu
邮箱: viacding.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:
以上所述及附带的任何信息 (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, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限公司 (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、股票或任何交易策略相关的推介、定价、建议或提示。“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, 所有陈述和保证均按披露为准。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang