



【2023-08-21】

中国央行今日开展 340 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 60 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 280 亿元。资金面均衡。7d repo fixing:1.95%，与上一交易日持平，3m shibor fixing: 2.0240%，与上一交易日下降 0.2bp。

Repo 端， 5y repo 早盘开在 2.3175%-2.31%，小幅上行至 2.315%-2.32%后震荡下行，成交在 2.315%-2.305%附近，午盘报收 30.5/30.25。下午，期货继续上行，5y repo 继续下行成交在 2.305%-2.285%附近，临近收盘，期货小幅走缓，5y 小幅回升，报收 30/29.75。1y repo 上午成交在 1.8875%-1.895%附近，午盘报收 89.5/89。午后，1y repo 下行成交在 1.88%-1.8925%附近，报收 89.75/89.5。其他期限，2y repo 成交在 1.975%-1.985%，3y repo 成交在 2.095%-2.0975%附近。曲线方面，2x5y repo spd 成交在 32.25bp，3x5y repo spd 成交在 21bp，1x5y repo spd 成交在 40.5-42bp，报收 40.5/40.25。

Shibor 端，5y shibor 成交在 2.5775%-2.59%附近，报收 57/56.5。1y shibor 成交在 2.07%-2.075%附近，报收 06.75/06.25。其他期限，2y shibor 成交在 2.17%附近，3y shibor 成交在 2.44%。曲线方面，4x5y shibor spd 成交在 13.75bp，1x5y shibor spd 成交在 51.5bp，报收 51/50.75。Basis 方面，5y basis 成交在 27-27.5bp，报收 27.25/26.5。1y basis 报收 17.5/16.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

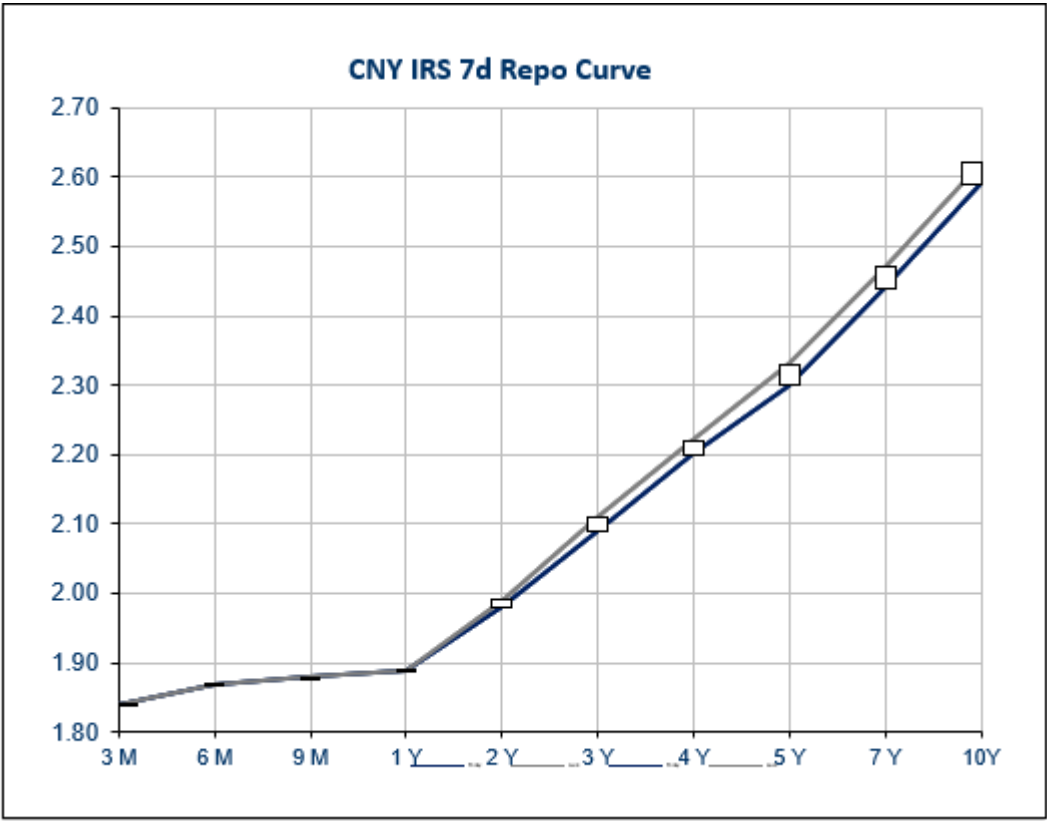
2023/8/21 Monday

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	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.84	-				3 M	1.54	-									
6 M	1.87	-	6 M	2.06	-1	6 M	1.51	-									
9 M	1.88	-	9 M	2.05	-2	9 M	1.52	-									
1 Y	1.89	-	1 Y	2.06	-2	1 Y	1.53	-							1Y	1.86	-1
2 Y	1.98	-1	2 Y	2.17	-2	2 Y	1.95	-				2 Y	1.65	-	2Y	1.92	-2
3 Y	2.09	-2	3 Y	2.3	-3	3 Y	1.95	-				3 Y	1.77	-	3Y	2.02	-3
4 Y	2.2	-2	4 Y	2.43	-4							4 Y	1.8	-	4Y	2.13	-3
5 Y	2.3	-3	5 Y	2.57	-4							5 Y	1.8	-	5Y	2.21	-4
7 Y	2.44	-3	7 Y	2.74	-4							7 Y	1.8	-			
10Y	2.59	-3	10Y	2.84	-4							10Y	1.8	-			
7D REPO	1.95	-	3M Shibor	2.024	-0.20	O-N Shibor	1.937	-0.90	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	3	-			Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	1	-	-1	-1			
9M*1Y	1	-	1	-	6M	19	-1
1*2Y	9	-1	11	-	9M	17	-2
1*3Y	20	-2	24	-1	1Y	17	-2
1*4Y	31	-2	37	-2	2Y	19	-1
1*5Y	41	-3	51	-2	3Y	21	-
2*3Y	11	-1	13	-1	4Y	23	-2
2*4Y	22	-1	26	-2	5Y	27	-1
2*5Y	32	-2	40	-2			
3*4Y	11	-	13	-1			
3*5Y	21	-1	27	-1			
4*5Y	10	-1	14	-			
5*7Y	14	-	17	-			
5*10Y	29	-	27	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	51	51	48	48	49	50	51
今日	51	51	48	48	49	50	51

Bond Swap	230015/5y repo	230012/5y repo	230203/5y repo	230210/5y repo
昨日	3	24	11	35
今日	4	24	12	35



联系人: Ruby Hu

邮箱: rubyhu@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”) 仅用以提供信息, 且为保密的、或者专用的信息, 其知识仅属于上海国际市场经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际”) 或第三方。“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, 也不保证其完整性、及时性或准确性等要素, 且可能随时被撤销或修改。所有陈述和保证均经特此免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang