



【2023-08-30】

 中国央行今日进行 3820 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.80%，此前为 1.80%。今日有 3010 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏紧。7d repo fixing：2.4%，与上一交易日上升 15bp，3m shibor fixing: 2.0360%，与上一交易日上升 0.8bp。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.375%附近，后震荡下行，成交在 2.375%-2.355%区间附近，午盘报收 36.25/35。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.3575%-2.3625%附近，尾盘报收 36/35.75。1y repo 全天震荡成交在 1.935%-1.9425%区间附近，尾盘报收 93.75/93.5。其他期限，1m repo 成交在 1.98%-2.00%区间附近，2m repo 成交在 1.97%附近，2y repo 成交在 2.0375%-2.0275%附近。曲线方面，1mx2m repo 成交在-1bp 附近，1x2y repo 成交在 09bp 附近，1x5y repo 成交在 42-42.25bp 附近，报收 42.25/42。

 Shibor 端，1y shibor 成交在 2.1325%-2.1275%附近，报收 13/12.5，5y shibor 报收 63/62.75。曲线方面，1x5 shibor 报收 50.5/49.75。基差方面，1y basis 报收 19.5/19，5y basis 报收 27.25/27。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

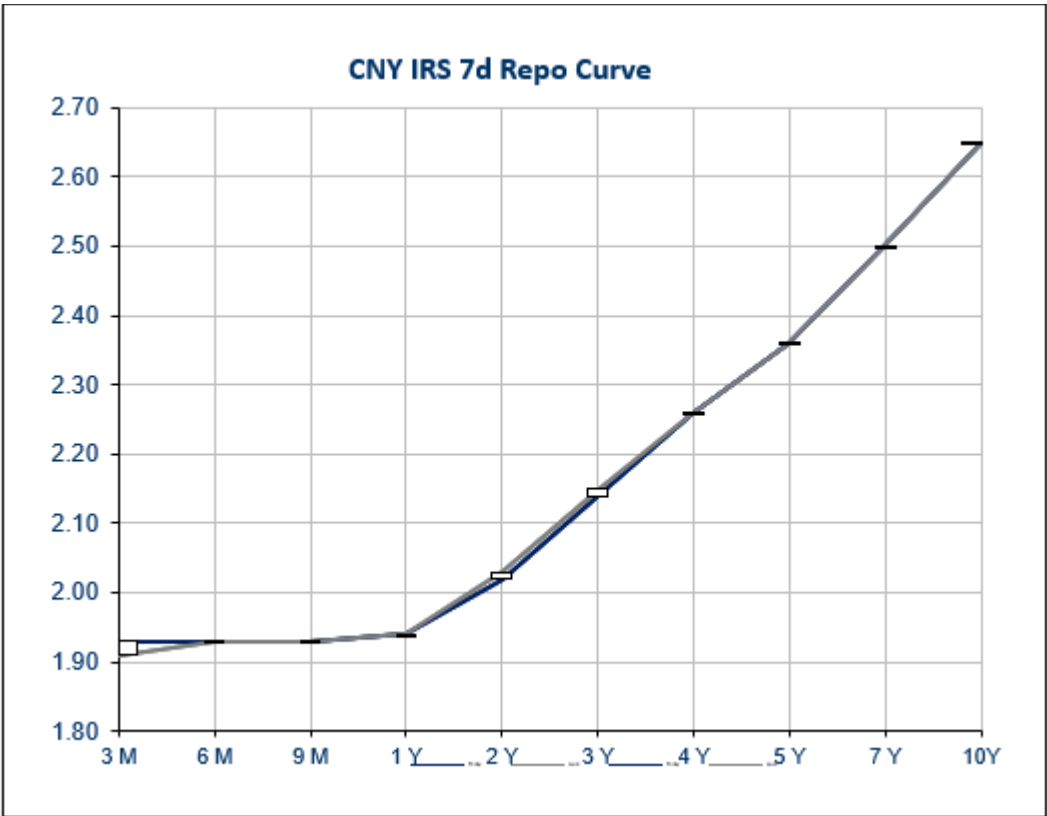
2023/8/30 星期三

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
3 M	1. 93	2				3 M	1. 54	-						
6 M	1. 93	-	6 M	2. 1	-1	6 M	1. 51	-						
9 M	1. 93	-	9 M	2. 11	-1	9 M	1. 52	-						
1 Y	1. 94	-	1 Y	2. 12	-1	1 Y	1. 53	-				1Y	1. 915	1
2 Y	2. 02	-1	2 Y	2. 23	-1	2 Y	1. 95	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 985	1
3 Y	2. 14	-1	3 Y	2. 36	-	3 Y	1. 95	-	3 Y	1. 77	-	3Y	2. 09	-
4 Y	2. 26	-	4 Y	2. 5	-1				4 Y	1. 8	-	4Y	2. 1975	-
5 Y	2. 36	-	5 Y	2. 62	-1				5 Y	1. 8	-	5Y	2. 285	-
7 Y	2. 5	-	7 Y	2. 79	-				7 Y	1. 8	-			
10Y	2. 65	-	10Y	2. 89	-				10Y	1. 8	-			
7D REPO	2.40	15.00	3M Shibor	2.036	0.80	O-N Shibor	1.911	-6.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0	-2			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	0	-	1	-				
9M*1Y	1	-	1	-	6M	17	-1	
1*2Y	8	-1	11	-	9M	18	-1	
1*3Y	20	-1	24	1	1Y	18	-1	
1*4Y	32	-	38	-	2Y	21	-	
1*5Y	42	-	50	-	3Y	22	-	
2*3Y	12	-	13	1	4Y	24	-1	
2*4Y	24	1	27	-	5Y	26	-1	
2*5Y	34	1	39	-				
3*4Y	12	1	14	-1				
3*5Y	22	1	26	-1				
4*5Y	10	-	12	-				
5*7Y	14	-	17	1				
5*10Y	29	-	27	1				

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	4	23	13	33
今日	3	23	11	33



联系人: Ruby Hu
邮箱: ruby.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证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际证券”) 或第三方。“信息”不应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。且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均按所述免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang