



【2023-08-24】

中国央行今日开展 610 亿元 7 天期逆回购操作，因今日有 1680 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 1070 亿元，资金面均衡。7d repo fixing:1.85%，与上一交易日相比下降 8bp，3m shibor fixing: 2.0160%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.325%附近，国债期货下行，5y repo 震荡行情成交在 2.3225%-2.33%附近，午盘报收 32.75/32.5。午后国债期货上行，5y repo 下行成交在 2.325%-2.3175%后略微震荡成交在 2.315%-2.32%附近，尾盘报收 32/31.75。1y repo 随资金面略微宽松下行成交在 1.8975%-1.8875%，尾盘报收 89.5/89.25。其他期限，3m repo 成交在 1.845%附近，6m repo 成交在 1.8675%-1.86%附近，2y repo 成交在 1.9875%附近，3y repo 成交在 2.1075%-2.105%，4y repo 成交在 2.22%附近。曲线方面，3m ×6m repo 成交在 01.75bp，6m×1y repo 成交在 02.5bp 附近， 2×3y repo 成交在 12bp 附近，1×3y repo 成交在 21.25bp 附近，3×4y repo 成交在 11.25bp 附近，6m×5y repo 成交在 45.75bp 附近，1×5y repo 成交在 43.25bp-42.5bp，报收 42.75/42.5。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.075%-2.0675%，报收 07/06.5， 5y shibor 成交在 2.60%-2.585%，报收 59.5/58.5。曲线方面， 1x5 shibor spd 成交在 52.5bp-52.25bp 附近。基差方面，1y basis 报收 17.75/17.25，5y basis 成交在 27.5bp 附近，报收 27.75/27。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

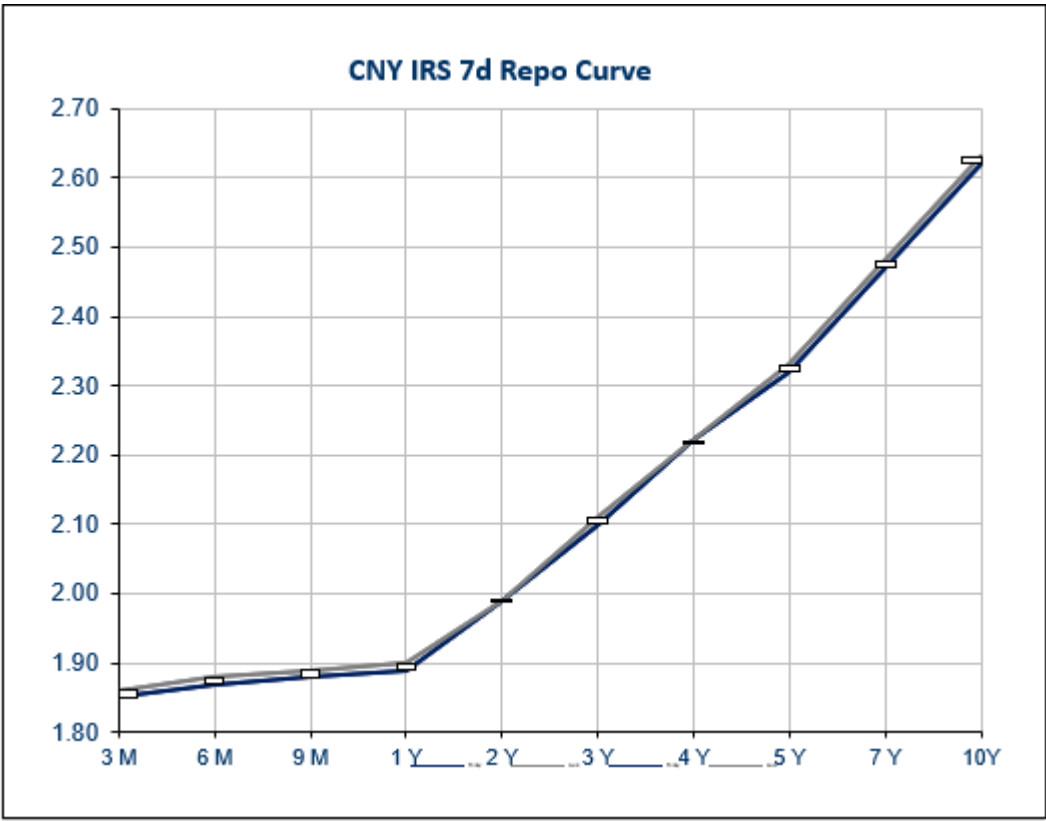
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
 2023/8/24 Thursday

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	1.85	-1				3 M	1.54	-						
6 M	1.87	-1	6 M	2.06	-1	6 M	1.51	-						
9 M	1.88	-1	9 M	2.06	-1	9 M	1.52	-						
1 Y	1.89	-1	1 Y	2.07	-	1 Y	1.53	-				1Y	1.87	-1
2 Y	1.99	-	2 Y	2.18	-1	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.94	-1
3 Y	2.1	-1	3 Y	2.32	-1	3 Y	1.95	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.05	-1
4 Y	2.22	-	4 Y	2.46	-1				4 Y	1.8	-	4Y	2.16	-1
5 Y	2.32	-1	5 Y	2.59	-1				5 Y	1.8	-	5Y	2.24	-2
7 Y	2.47	-1	7 Y	2.76	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.62	-1	10Y	2.86	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.85	-8.00	3M Shibor	2.016	-	O-N Shibor	1.569	-16.90	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	2	-			Tenor	Mid	Δbp	
6M*9M	1	-	0	-				
9M*1Y	1	-	1	1	6M	19	-	
1*2Y	10	1	11	-1	9M	18	-	
1*3Y	21	-	25	-1	1Y	18	1	
1*4Y	33	1	39	-1	2Y	19	-1	
1*5Y	43	-	52	-1	3Y	22	-	
2*3Y	11	-1	14	-	4Y	24	-1	
2*4Y	23	-	28	-	5Y	27	-	
2*5Y	33	-1	41	-				
3*4Y	12	1	14	-				
3*5Y	22	-	27	-				
4*5Y	10	-1	13	-				
5*7Y	15	-	17	-				
5*10Y	30	-	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	23	12	34
今日	4	24	12	34



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Hu
邮箱: xiaoting.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, 且为保密的和/或专有的信息。其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际货币”) 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、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、时效性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN