

## 利率衍生产品市场每日简评

2019年08月14日

未经授权，不得引用或者转发，否则追究法律责任

### 市场概况

#### 消息面

资金：资金面较为紧张。

公开市场：中国央行今日进行1000亿逆回购操作，逆回购没有到期。

数据：工业产值同比：实际：4.8%，调查：6.0%，上次：6.3%

#### 今日市场概述

今日市场先抑后扬，5y repo率先成交在2.825%，随后窄幅上行，在2.8275%、2.83%位置tkn。1y repo成交在2.62%，repo 1y\*5y gvn在20.75bp。后受金融数据影响，市场下行，5y从2.8175%gvn，最低在2.80%位置有成交。1y repo成交在2.6025%、2.605%和2.6075%。Shibor方面，shibor 5y gvn在3.215%、3.21%和3.20%，s/r 5y在40bp trd。

午市开盘，5y repo成交在2.81%、2.8125%、2.8175%、2.82%，1y repo在2.6125%、2.61%有成交，repo 1\*5在20.5bp trd。尾盘，市场略有反弹，在2.82%、2.8225%有成交。Shibor 2y成交在2.9625%，5y成交在3.22%，shibor 2\*5y在25.75bp gvn。

#### 定盘利率

本日r007 fixing在2.9000，持平；dr007 fixing在2.67，下跌.00bps；3m shibor fixing在2.6560，上升1.20bp；ois fixing在2.6890，上升2.20bps。

## 市场价格

IRS Qtrly/7d Repo ACT/365(F)			IRS Annually/1Y DEPO A/365 (F) A/360(F)			IRS Qtrly/3m SHIBOR A/365 (F) A/360(F)		
Tenor	Mid-rate	Change	Tenor	Mid-rate	Change	Tenor	Mid-rate	Change
1 M	2.710	+1.0						
2 M	2.680	+1.0						
3 M	2.620	0.0						
6 M	2.610	+0.5				6 M	2.765	+0.5
9 M	2.610	+1.0				9 M	2.820	+1.0
1 Y	2.610	+1.0				1 Y	2.870	+2.0
2 Y	2.640	+1.5	2 Y	1.650	0.0	2 Y	2.960	+1.0
3 Y	2.685	+1.5	3 Y	1.630	0.0	3 Y	3.050	+2.0
4 Y	2.745	+1.5	4 Y	1.590	0.0	4 Y	3.135	+1.0
5 Y	2.825	+2.0	5 Y	1.600	0.0	5 Y	3.225	+1.5
7 Y	2.965	+2.0	7 Y	1.650	0.0	7 Y	3.410	+1.5
10Y	3.115	+2.0	10Y	1.750	0.0	10Y	3.560	+1.5
IRS Annually/O-N SHIBOR A/365 (F) A/360(F)			OFFSHORE IRS Qtrly/7d Repo A/365			Floating Rate Fixing		
Tenor	Mid-rate	Change	Tenor	Mid-rate	Change	Floating	Fix-rate	Change
1 M	2.000	+3.0	1Y	2.490	0.0	7D REPO	2.9000	0
3 M	2.150	+3.0	2Y	2.520	0.0	1Y DEPO	1.5000	0
6 M	2.150	+3.0	3Y	2.580	0.0	3M Shibor	2.6560	+1.20
9 M	2.200	+6.0	4Y	2.650	0.0	O-N Shibor	2.6890	+2.20
1 Y	2.325	+6.0	5Y	2.690	0.0	1Y LOAN	4.3500	0

IRS Quarterly/1Y DEPO A/365 (F) A/360(F)		
Tenor	Mid	Δbp
1Y	1.650	0.0
2 Y	1.550	0.0
3 Y	1.440	0.0
4 Y	1.440	0.0
5 Y	1.440	0.0

数据来源: Tullett Prebon SITICO(China),  
Tullett Prebon(Hongkong), Tullett Prebon(Singapore)  
路透代码:TPSD

感谢对我们公司的关注!

本简评仅供参考，不代表任何交易建议。

利率衍生产品市场部