



【2024-08-08】

中国央行今日进行 71 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 103.7 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 32.7 亿元。资金面上午偏紧，下午转均衡。7d repo fixing: 1.85%，与上一交易日上升 2bp，3m shibor fixing: 1.8350%，与上一交易日下降 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.835%附近，后小幅震荡成交在 1.845%-1.835%区间附近，午盘报收 84.5/84.25。中午回来，5y repo 震荡上行，成交在 1.855%-1.84%区间附近，报收 85.5/85。1y repo 全天震荡成交在 1.755%-1.7325%区间附近，报收 75/74.5。其他期限，2y repo 成交在 1.7325%-1.73%，3y repo 成交在 1.7525%-1.75%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在-01.25bp 点位，2x5y repo 成交在 11.75bp 点位，3x5y repo 成交在 09.5bp，1x5y repo 成交在 10.25bp-10.50bp 区间附近，报收 10.75/10.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 83/82，5y shibor 报收 92.25/91.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 10.25/08.5。基差方面，1y basis 报收 08/07.5，5y basis 报收 07/06.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

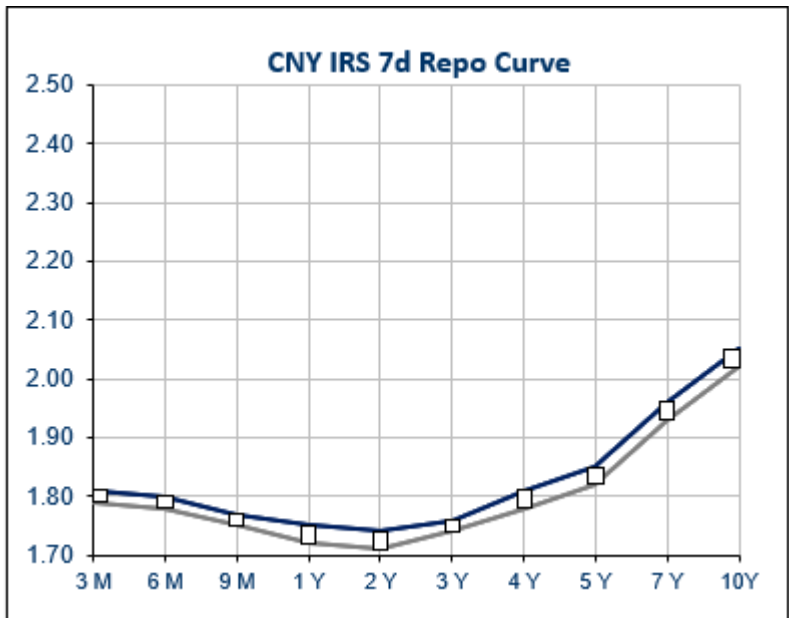
2024/8/8 Thursday

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	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.81	2				3 M	1.68	2									
6 M	1.8	2	6 M	1.88	2	6 M	1.66	1									
9 M	1.77	2	9 M	1.85	2	9 M	1.64	1									
1 Y	1.75	3	1 Y	1.83	3	1 Y	1.75	-							1Y	1.74	2
2 Y	1.74	3	2 Y	1.8	2	2 Y	1.62	1	2 Y	1.65	-	2 Y	1.71	2	2Y	1.71	2
3 Y	1.76	2	3 Y	1.83	3	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3 Y	1.73	3	3Y	1.73	3
4 Y	1.81	3	4 Y	1.87	3				4 Y	1.8	-	4 Y	1.77	2	4Y	1.77	2
5 Y	1.85	3	5 Y	1.92	3				5 Y	1.8	-	5 Y	1.81	4	5Y	1.81	4
7 Y	1.96	3	7 Y	2	3				7 Y	1.8	-						
10Y	2.05	3	10Y	2.09	3				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.85	2.00	3M Shibor	1.835	-0.40	0-N Shibor	1.681	6.40	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-1	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	-	-3	-				
9M*1Y	-2	1	-2	1	6M	8	-	
1*2Y	-1	-	-3	-1	9M	8	-	
1*3Y	1	-1	0	-	1Y	8	-	
1*4Y	6	-	4	-	2Y	6	-1	
1*5Y	10	-	9	-	3Y	7	1	
2*3Y	2	-1	3	1	4Y	6	-	
2*4Y	7	-	7	1	5Y	7	-	
2*5Y	11	-	12	1				
3*4Y	5	1	4	-				
3*5Y	9	1	9	-				
4*5Y	4	-	5	-				
5*7Y	11	-	8	-				
5*10Y	20	-	17	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	37	34	32	26	23	22	21
今日	37	34	32	26	23	22	21

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-4	27	3	33
今日	-3	29	3	35



联系人: Ruby Wu
邮箱: visiting.bu@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:

以上所发及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国际货币经纪有限公司 (以下简称“上海国际货币”) 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、建议或诱导。“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, 所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang