



【2024-08-07】

中国央行：今日无新做逆回购。今日有 2516.7 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 2516.7 亿元。资金面整体均衡稍紧，7d repo fixing：1.83%，与上一交易日下降 1bp，3m shibor fixing: 1.8390%，与上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.82%附近，后小幅震荡成交在 1.8275%-1.8175%区间附近，午盘报收 82.5/82.25。中午回来，5y repo 维持区间震荡，成交在 1.825%-1.8175%区间附近，报收 82.25/82。1y repo 全天震荡成交在 1.7275%-1.72%区间附近，报收 72.5/72.25。其他期限，6m 成交在 1.7725%附近，2y repo 成交在 1.7175%附近。曲线方面，1x2y repo 成交在-01.25bp 点位，1x5y repo 成交在 09.75bp-10bp 区间附近，报收 10/09.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 80.25/79.25，5y shibor 报收 89.25/88.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 10/08.25。基差方面，1y basis 报收 07.75/07，5y 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

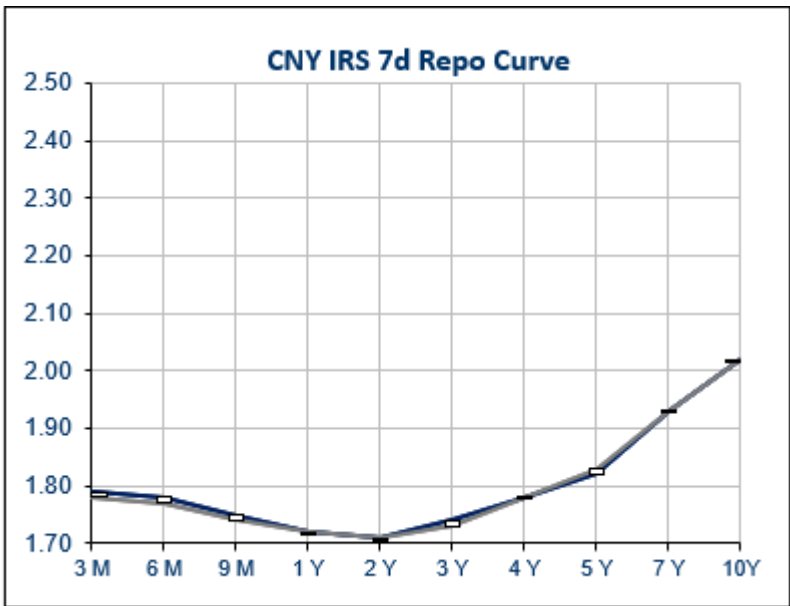
2024/8/7 Wednesday

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
3 M	1.79	1				3 M	1.66	1						
6 M	1.78	1	6 M	1.86	2	6 M	1.65	–						
9 M	1.75	1	9 M	1.83	1	9 M	1.63	–						
1 Y	1.72	–	1 Y	1.8	1	1 Y	1.75	13				1Y	1.72	1
2 Y	1.71	–	2 Y	1.78	–1	2 Y	1.61	–	2 Y	1.65	–	2Y	1.69	1
3 Y	1.74	1	3 Y	1.8	–	3 Y	1.75	–	3 Y	1.77	–	3Y	1.7	1
4 Y	1.78	–	4 Y	1.84	–				4 Y	1.8	–	4Y	1.75	1
5 Y	1.82	–1	5 Y	1.89	–				5 Y	1.8	–	5Y	1.77	–
7 Y	1.93	–	7 Y	1.97	–1				7 Y	1.8	–			
10Y	2.02	–	10Y	2.06	–1				10Y	1.8	–			
7D REPO	1.83	–1.00	3M Shibor	1.839	–0.50	0-N Shibor	1.617	3.40	1Y DEPO	1.50				

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

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	-3	28	3	35
今日	-4	27	3	33



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”）仅提供供您参考，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