



【2024-08-06】

中国央行：今日进行 6.2 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.70%，与此前持平。今日有 2162.7 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 2156.5 亿元。资金面上午均衡，下午均衡偏松。7d repo fixing：1.84%，与上一交易日上升 4bp，3m shibor fixing: 1.8440%，与上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.84%附近，后小幅震荡成交在 1.8375%-1.845%区间附近，午盘报收 83.75/83.5。中午回来，5y repo 小幅震荡下行，成交在 1.825%-1.84%区间附近，报收 82.75/82.25。1y repo 全天震荡成交在 1.72%-1.7325%区间附近，报收 72 /71.5。其他期限，2y repo 成交在 1.72%-1.725%区间附近，3y repo 成交在 1.7475%附近，4y repo 成交在 1.78%附近。曲线方面，2x5y repo 成交在 11.5bp 点位，1x5y repo 成交在 10.5-11bp 区间附近，报收 11/10.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 80.25/79.75，5y shibor 报收 89.5/88.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 09.75/08.25。基差方面，1y basis 报收 08.25/07.75，5y 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

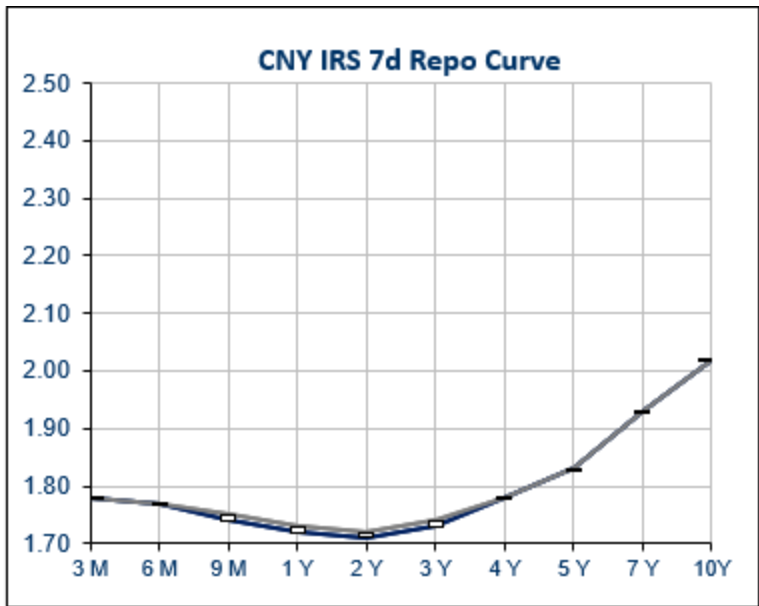
2024/8/6 Tuesday

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	1.78	–				3 M	1.65	–						
6 M	1.77	–	6 M	1.84	–1	6 M	1.65	2						
9 M	1.74	–1	9 M	1.82	–	9 M	1.63	–2						
1 Y	1.72	–1	1 Y	1.79	–1	1 Y	1.62	–13				1Y	1.71	–1
2 Y	1.71	–1	2 Y	1.79	–	2 Y	1.61	–1	2 Y	1.65	–	2Y	1.68	–
3 Y	1.73	–1	3 Y	1.8	–	3 Y	1.75	–	3 Y	1.77	–	3Y	1.69	–
4 Y	1.78	–	4 Y	1.84	–1				4 Y	1.8	–	4Y	1.74	–
5 Y	1.83	–	5 Y	1.89	–1				5 Y	1.8	–	5Y	1.77	–
7 Y	1.93	–	7 Y	1.98	–1				7 Y	1.8	–			
10Y	2.02	–	10Y	2.07	1				10Y	1.8	–			
7D REPO	1.84	4.00	3M Shibor	1.844	–0.50	0-N Shibor	1.583	–0.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-1	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	-1	-2	1				
9M*1Y	-2	-	-3	-1	6M	7	-1	
1*2Y	-1	-	0	1	9M	8	1	
1*3Y	1	-	1	1	1Y	7	-	
1*4Y	6	1	5	-	2Y	8	1	
1*5Y	11	1	10	-	3Y	7	1	
2*3Y	2	-	1	-	4Y	6	-1	
2*4Y	7	1	5	-1	5Y	6	-1	
2*5Y	12	1	10	-1				
3*4Y	5	1	4	-1				
3*5Y	10	1	9	-1				
4*5Y	5	-	5	-				
5*7Y	10	-	9	-				
5*10Y	19	-	18	2				

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	28	2	34
今日	-3	28	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