



【2024-08-09】

中国央行今日开展 129 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率持平 1.7%。因今日有 11.7 亿元逆回购到期，当日实现净投放 117.3 亿元。中国央行本周共开展 212.9 亿元逆回购操作，因本周共有 7810.5 亿元逆回购到期，本周实现净回笼 7597.6 亿元。资金面整体均衡稍紧。7d repo fixing: 1.86%，与上一交易日上升 1bp，3m shibor fixing: 1.8335%，与上一交易日下降 0.15bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.8575%附近，后小幅震荡上行，成交在 1.8575%-1.8725 %附近，午盘报收 86.75/86.25。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.8575%-1.8675%位置附近，报收 87.25/87。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.75%-1.765%区间附近，报收 76.5/76。其他期限，3m repo 成交 1.805%附近，6m repo 成交 1.805%附近，2y repo 成交在 1.7425%-1.75%区间附近，7y repo 成交在 1.945%附近。曲线方面，6mx1y repo 成交-4.75bp 附近，2x5y repo 成交在 12-11.5bp 点位附近，1x5y repo 成交在 11bp 附近，报收 11.25/10.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 85/84，5y shibor 报收 94.5/93.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 09.5/09。基差方面，1y basis 报收 08.5/07.75，5y basis 报收 07.25/06.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

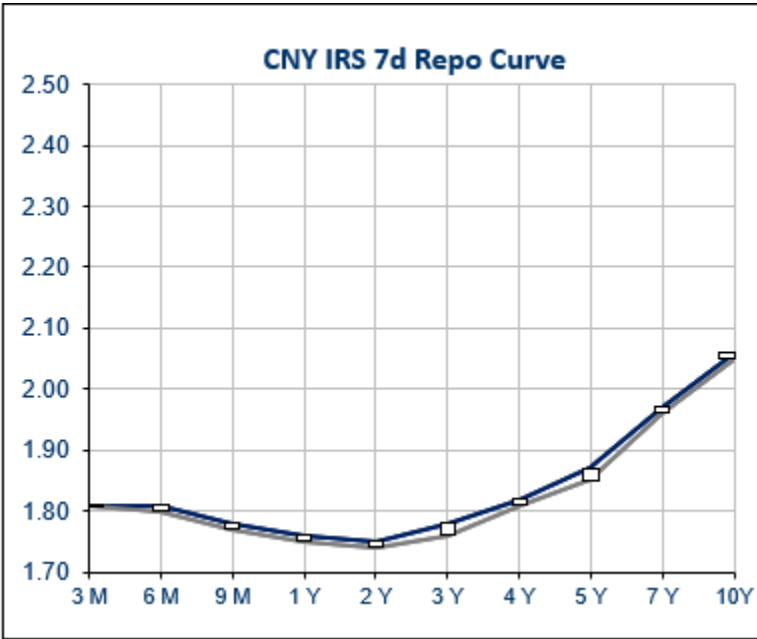
2024/8/9 Friday

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	1.81	-				3 M	1.67	-1									
6 M	1.81	1	6 M	1.88	-	6 M	1.66	-									
9 M	1.78	1	9 M	1.86	1	9 M	1.65	1									
1 Y	1.76	1	1 Y	1.84	1	1 Y	1.75	-				1Y	1.75	1			
2 Y	1.75	1	2 Y	1.82	2	2 Y	1.63	1	2 Y	1.65	-	2Y	1.73	2			
3 Y	1.78	2	3 Y	1.84	1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.74	1			
4 Y	1.82	1	4 Y	1.89	2				4 Y	1.8	-	4Y	1.78	1			
5 Y	1.87	2	5 Y	1.94	2				5 Y	1.8	-	5Y	1.82	1			
7 Y	1.97	1	7 Y	2.01	1				7 Y	1.8	-						
10Y	2.06	1	10Y	2.11	2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.86	1.00	3M Shibor	1.8335	-0.15	0-N Shibor	1.778	9.70	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	0	1			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	-	-2	1				
9M*1Y	-2	-	-2	-	6M	7	-1	
1*2Y	-1	-	-2	1	9M	8	-	
1*3Y	2	1	0	-	1Y	8	-	
1*4Y	6	-	5	1	2Y	7	1	
1*5Y	11	1	10	1	3Y	6	-1	
2*3Y	3	1	2	-1	4Y	7	1	
2*4Y	7	-	7	-	5Y	7	-	
2*5Y	12	1	12	-				
3*4Y	4	-1	5	1				
3*5Y	9	-	10	1				
4*5Y	5	1	5	-				
5*7Y	10	-1	7	-1				
5*10Y	19	-1	17	-				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	37	34	32	26	23	22	21
今日	37	34	33	27	25	23	22

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	-3	29	3	35
今日	-2	29	5	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, 且为保密的利/或者专用的信息, 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、建议或请求。“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, 所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang