



【2023-08-02】

中国央行今日进行 90 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.90%，与此前持平。今日有 1040 亿元逆回购到期。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.83%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 2.0980%，与上一交易日不变。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 2.505%附近，后小幅震荡下行，在 2.5075%-2.495%区间附近震荡成交，午盘报收 50/49.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 2.5025%-2.495%区间附近，尾盘报收 50/49.75。1y repo 全天随长端震荡成交在 2.0275%-2.015%区间附近，尾盘报收 02/01.75。其他期限，6m repo 成交在 1.975%附近，9m repo 成交在 2.0025%附近，2y repo 成交在 2.13%-2.1275%区间附近，3y repo 成交在 2.2675%附近。曲线方面，6mx9m repo 成交在 02.75bp 附近，9mx1y repo 成交在 02.25bp 附近，6mx1y repo 成交在 04.75bp 附近，1x2y repo 成交在 11-10.75bp 附近，2x3y repo 成交在 14bp 附近，3x5y repo 成交在 23.25bp 附近，2x5y repo 成交在 36.75bp 附近，1x5y repo 成交在 48-48.25bp 附近，报收 48/47.75。

Shibor 端，1y shibor 报收 20.75/20.5，2y shibor 成交在 2.3475%-2.3425%附近，5y shibor 报收 79.5/78.75。曲线方面，1x5y shibor 报收 58.75/58。基差方面，1y basis 报收 19.25/18.75，5y basis 报收 29.5/29。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/8/2 Wednesday

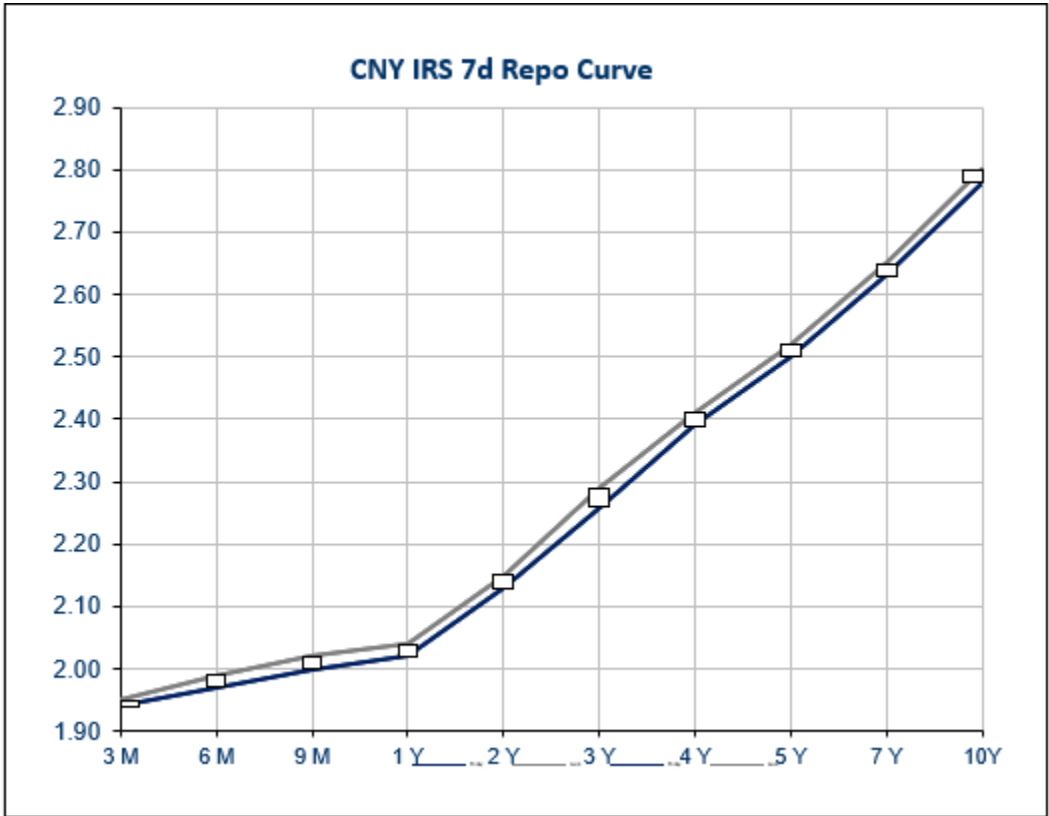
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd												OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO					
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365					
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp			
3 M	1.94	-1				3 M	1.59	-									
6 M	1.97	-2	6 M	2.14	-1	6 M	1.51	-									
9 M	2	-2	9 M	2.17	-2	9 M	1.51	-									
1 Y	2.02	-2	1 Y	2.21	-2	1 Y	1.6	-				1Y	2	-2			
2 Y	2.13	-2	2 Y	2.34	-2	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.1	-2			
3 Y	2.26	-3	3 Y	2.49	-3	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.24	-2			
4 Y	2.39	-2	4 Y	2.65	-2				4 Y	1.8	-	4Y	2.36	-2			
5 Y	2.5	-2	5 Y	2.79	-3				5 Y	1.8	-	5Y	2.46	-2			
7 Y	2.63	-2	7 Y	2.96	-3				7 Y	1.8	-						
10Y	2.78	-2	10Y	3.06	-3				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.83	-2.00	3M Shibor	2.098	-	O-N Shibor	1.3013	-25.67	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO	SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	3 -1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	3 -	3 -1				
9M*1Y	2 -	4 -	6M	17	1	
1*2Y	11 -	13 -	9M	17	-	
1*3Y	24 -1	28 -1	1Y	19	-	
1*4Y	37 -	44 -	2Y	21	-	
1*5Y	48 -	58 -1	3Y	23	-	
2*3Y	13 -1	15 -1	4Y	26	-	
2*4Y	26 -	31 -	5Y	29	-1	
2*5Y	37 -	45 -1				
3*4Y	13 1	16 1				
3*5Y	24 1	30 -				
4*5Y	11 -	14 -1				
5*7Y	13 -	17 -				
5*10Y	28 -	27 -				

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	58	57	56	56	57	59	60
今日	58	57	56	56	57	59	60

Bond Swap	230002/5y repo	230004/5y repo	230203/5y repo	230205/5y repo
-----------	----------------	----------------	----------------	----------------

昨日	-6	17	5	32
今日	-6	18	7	34



联系人: Ruby Hu
邮箱: xiaoting.hu@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、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、投资策略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订。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang