



【2023-08-01】

中国央行今日开展 80 亿元逆回购操作，因今日有 440 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 360 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.85%，较上一交易日下降 12bp。3m shibor fixing: 2.0980%，较上一交易日上行 0.1bp。

Repo 端，5y repo 开盘在 2.505%-2.5025%，后随国债期货上行，5y repo 下行成交在 2.5025%-2.495%附近，午盘报收 49.75/49.5。午后，期货转向震荡下行，5y repo 上行 tkn 至 2.515%后成交在 2.5125%-2.505%附近。尾盘 5y repo 上行成交在至 2.5175%附近，报收 51.75/51.5。1y repo 随长端成交在 2.02%-2.035%，尾盘报收 04/03.5。其他期限，2y repo 成交在 2.135%附近，3y repo 成交在 2.275%附近。曲线方面，9mx1y repo spd 成交在 1.75bp，2x3y repo spd 成交在 14bp 附近，2x5y repo spd 成交在 37bp，3x5y repo spd 成交在 23bp，1x5y repo spd 成交在 47-48bp 附近，报收 48.25/47.75。

Shibor 方面，1y shibor 报收 18.75/18.25，5y shibor 报收 82.25/81。其他期限。曲线方面，1x5y shibor spd 报收 59.5/58.5。Basis 方面，1y basis 报收 18.75/18.25，5y basis 报收 30/29。

其他方面，报价寥寥未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

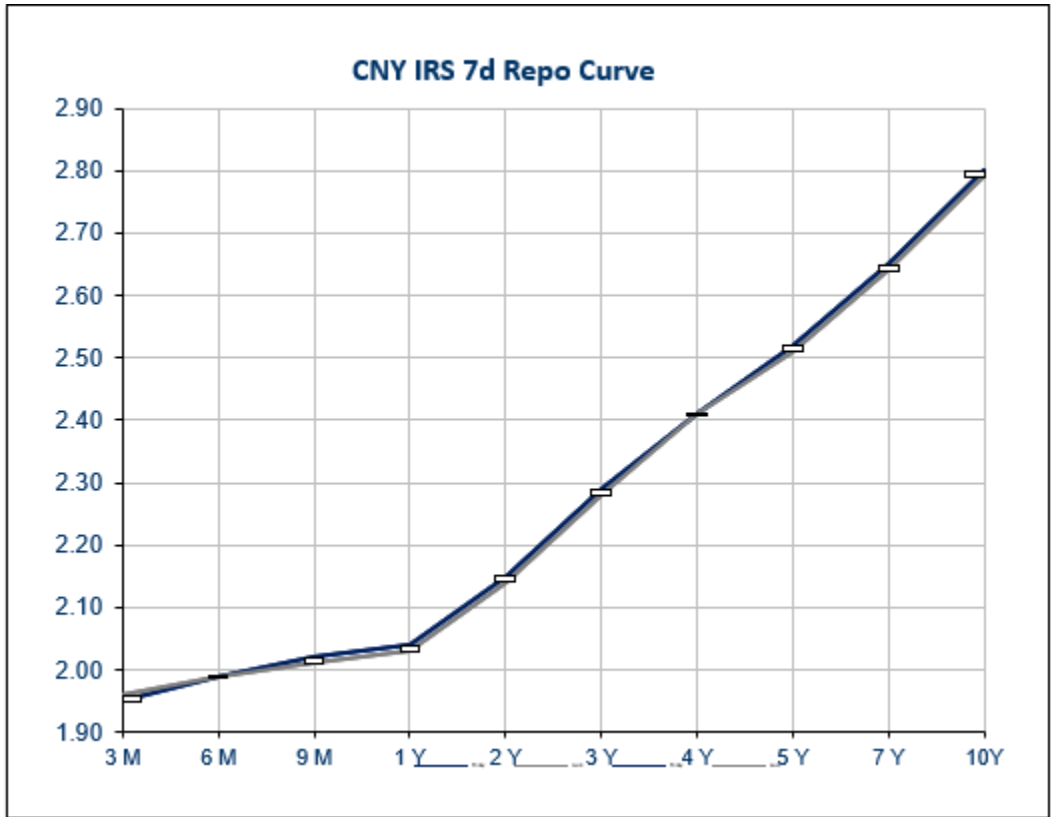
2023/8/1 Tuesday

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	1.95	-1				3 M	1.59	-									
6 M	1.99	-	6 M	2.15	1	6 M	1.51	-									
9 M	2.02	1	9 M	2.19	1	9 M	1.51	-									
1 Y	2.04	1	1 Y	2.23	2	1 Y	1.6	-				1Y	2.02	-			
2 Y	2.15	1	2 Y	2.36	2	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.12	-1			
3 Y	2.29	1	3 Y	2.52	1	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.26	-			
4 Y	2.41	-	4 Y	2.67	1				4 Y	1.8	-	4Y	2.38	-1			
5 Y	2.52	1	5 Y	2.82	2				5 Y	1.8	-	5Y	2.48	-			
7 Y	2.65	1	7 Y	2.99	2				7 Y	1.8	-						
10Y	2.8	1	10Y	3.09	2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.85	-12.00	3M Shibor	2.098	0.10	O-N Shibor	1.558	-28.90	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	4	1		Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	3	1	4 -				
9M*1Y	2	-	4 1	6M	16	1	
1*2Y	11	-	13 -	9M	17	-	
1*3Y	25	-	29 -1	1Y	19	1	
1*4Y	37	-1	44 -1	2Y	21	1	
1*5Y	48	-	59 -	3Y	23	-	
2*3Y	14	-	16 -1	4Y	26	1	
2*4Y	26	-1	31 -1	5Y	30	1	
2*5Y	37	-	46 -				
3*4Y	12	-1	15 -				
3*5Y	23	-	30 1				
4*5Y	11	1	15 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	6	33



联系人: Ruby Wu

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。其知识仅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”) 或其三方。“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、时效性或准确性等要素, 且可未经通知而进行修改。所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang