



【2023-08-03】

中国央行今日开展 30 亿元逆回购操作，因今日有 1140 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 1110 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.75%，较上一交易日下降 8bp，3m shibor fixing: 2.0920%，较上一交易日下降 0.6bp。中国 7 月财新服务业 PMI 前值 53.9 预期 52.4 公布 54.1; 中国 7 月财新综合 PMI 前值 52.5 预期 公布 51.9。

Repo 端，5y repo 早盘开在 2.4825%，受资金面宽松及期货走势影响，最低成交至 2.4675%，最高成交在 2.485%位置，成交区间在 2.4675%-2.485%区间，午盘报收 47.5/47。午后，5y repo 成交在 2.475%，成交区间在 2.46%-2.4775%区间附近，尾盘报收 46.5/46.25。1y repo 早盘开在 2.0025%，全天成交区间集中在 1.9775%-2.005%区间，尾盘报收 98.5/98.25。盘中，6m repo 成交在 1.9425%-1.9625%，9m repo 成交在 1.9625%-1.985%，2y repo 成交在 2.105%，3y repo 成交在 2.24%-2.2425%，4y repo 成交在 2.3725%-2.3775%。曲线方面，6mx1y repo 成交在 04.75bp，1x2y repo spd 成交在 10.75bp，1x5y repo spd 成交在 47.75bp-48.25bp，报收 48.25/47.75。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.1725%-2.19%附近，报收 18/17，2y shibor 成交在 2.31%-2.3125%附近，5y shibor 成交在 2.76%-2.7725%，报收 76.5/75.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 59.25/57.75。基差方面，1y basis 报收 19.5/19，5y basis 成交 29.5bp，报收 30/29.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

2023/8/3 Thursday

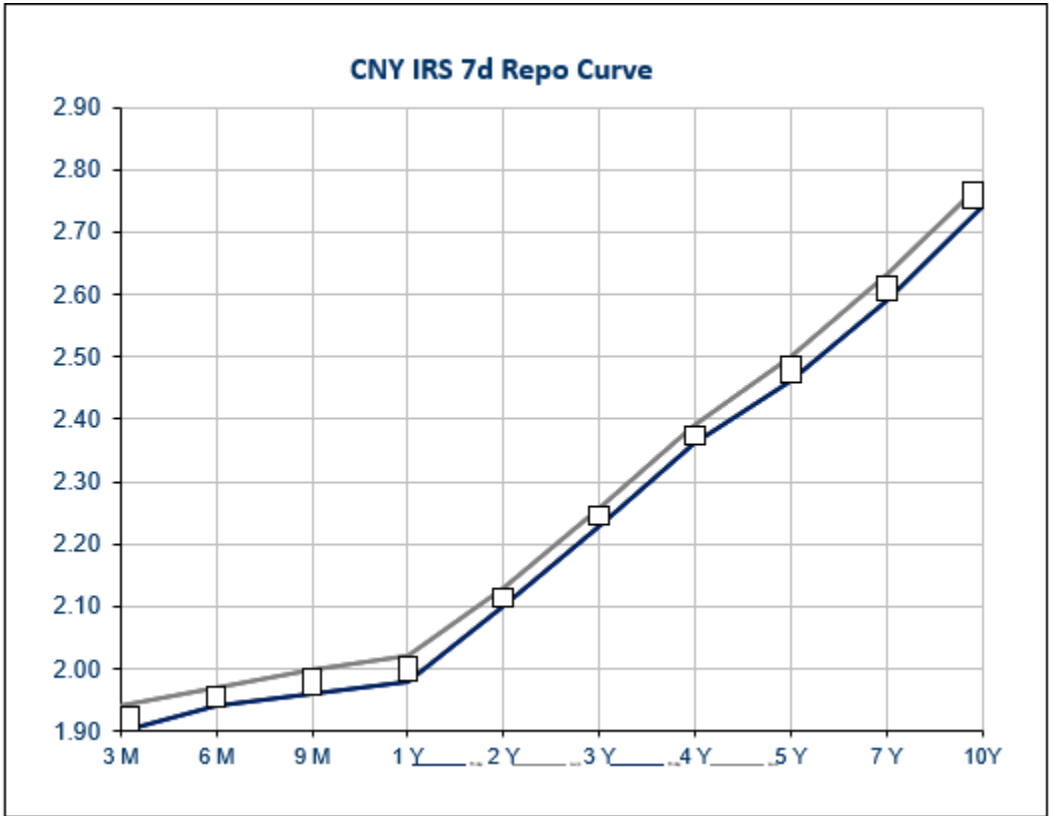
ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd												OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR			Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO					
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365					
Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.9	-4				3 M	1.59	-									
6 M	1.94	-3	6 M	2.13	-1	6 M	1.51	-									
9 M	1.96	-4	9 M	2.15	-2	9 M	1.51	-									
1 Y	1.98	-4	1 Y	2.17	-4	1 Y	1.6	-				1Y	1.97	-3			
2 Y	2.1	-3	2 Y	2.31	-3	2 Y	1.95	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.07	-3			
3 Y	2.23	-3	3 Y	2.46	-3	3 Y	1.98	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.21	-3			
4 Y	2.36	-3	4 Y	2.62	-3				4 Y	1.8	-	4Y	2.34	-2			
5 Y	2.46	-4	5 Y	2.76	-3				5 Y	1.8	-	5Y	2.43	-3			
7 Y	2.59	-4	7 Y	2.93	-3				7 Y	1.8	-						
10Y	2.74	-4	10Y	3.03	-3				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.75	-8.00	3M Shibor	2.092	-0.60	O-N Shibor	1.083	-21.83	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR	BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	4	1		Tenor	Mid	Δ bp
6M*9M	2	-1	2	-1		
9M*1Y	2	-	2	-2	6M	19 2
1*2Y	12	1	14	1	9M	19 2
1*3Y	25	1	29	1	1Y	19 -
1*4Y	38	1	45	1	2Y	21 -
1*5Y	48	-	59	1	3Y	23 -
2*3Y	13	-	15	-	4Y	26 -
2*4Y	26	-	31	-	5Y	30 1
2*5Y	36	-1	45	-		
3*4Y	13	-	16	-		
3*5Y	23	-1	30	-		
4*5Y	10	-1	14	-		
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	18	7	34
今日	-5	20	5	36



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,且为保密的和/或专有的信息,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订。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang