



【2024-07-31】

中国央行：今日进行 2516.7 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 661 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净投放 1855.7 亿元。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 1.8600%，与上一交易日下降 0.5bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.8325%附近，后小幅震荡成交在 1.83%-1.845%区间附近，午盘报收 84.5/84。中午回来，5y repo 继续震荡成交在 1.8375%-1.845%区间附近，报收 84.25/84。1y repo 全天震荡成交在 1.7125%-1.725%区间附近，报收 72.75/72.25。其他期限，6m repo 成交在 1.7575%-1.7625%区间附近，9m repo 成交在 1.7325%附近。曲线方面，3mx6m repo 成交在-1.5bp 点位，6mx9m repo 成交在-2.75bp 点位，9mx1y repo 成交在-1.75bp 点位，1x5y repo 成交在 11.75bp 点位，报收 12/11.5。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 80.75/79.75，5y shibor 报收 91/90.5。曲线方面，1x5y shibor 报收 11.25/09.75。基差方面，1y basis 报收 08.25/07.5，5y basis 报收 07/06.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

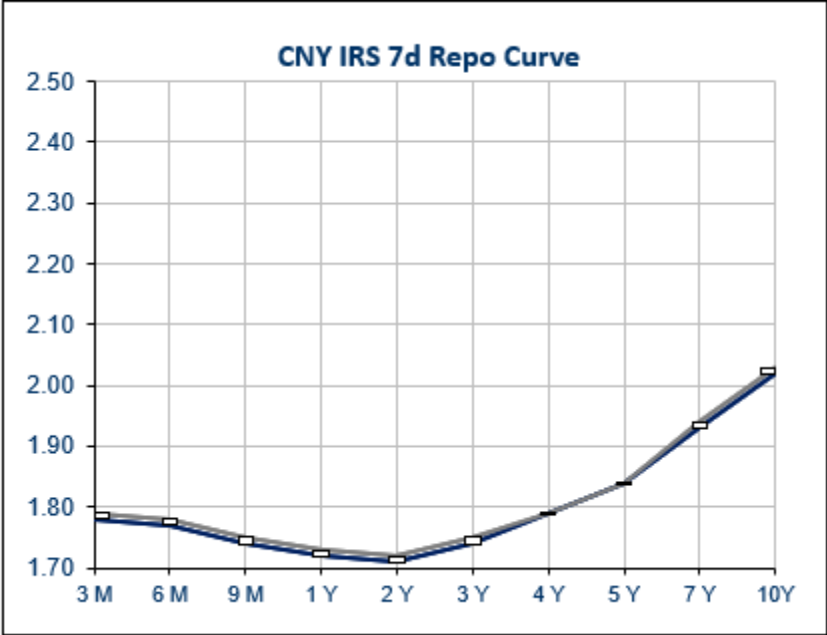
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/7/31 Wednesday

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	-1				3 M	1.68	1						
6 M	1.77	-1	6 M	1.85	-	6 M	1.66	1						
9 M	1.74	-1	9 M	1.83	-	9 M	1.66	2						
1 Y	1.72	-1	1 Y	1.8	-1	1 Y	1.75	-				1Y	1.71	-1
2 Y	1.71	-1	2 Y	1.79	-1	2 Y	1.62	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.69	-1
3 Y	1.74	-1	3 Y	1.81	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.71	-1
4 Y	1.79	-	4 Y	1.85	-2				4 Y	1.8	-	4Y	1.76	-1
5 Y	1.84	-	5 Y	1.9	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.79	-2
7 Y	1.93	-1	7 Y	2	-1				7 Y	1.8	-			
10Y	2.02	-1	10Y	2.09	-1				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.90	-3.00	3M Shibor	1.86	-0.50	0-N Shibor	1.782	14.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
					Tenor	Mid	Δ bp	
3M*6M	-1	-						
6M*9M	-3	-	-2	-				
9M*1Y	-2	-	-3	-1	6M	8	1	
1*2Y	-1	-	-1	-	9M	9	1	
1*3Y	2	-	1	-	1Y	8	-	
1*4Y	7	1	5	-1	2Y	8	-	
1*5Y	12	1	10	-	3Y	7	-	
2*3Y	3	-	2	-	4Y	6	-2	
2*4Y	8	1	6	-1	5Y	6	-1	
2*5Y	13	1	11	-				
3*4Y	5	1	4	-1				
3*5Y	10	1	9	-				
4*5Y	5	-	5	1				
5*7Y	9	-1	10	-				
5*10Y	18	-1	19	-				

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	0	29	6	36
今日	-2	29	4	36



联系人: Ruby Wu
邮箱: rubywu@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:
以上所发及所附的所有信息 (以下简称“信息”) 仅供以提供信息, 且为保密的和/或受有限的信息, 其知识仅属于上海国际货币经纪有限公司 (以下简称“上海国际货币”) 或其三方。“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、建议或建议。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、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