



【2024-08-01】

中国央行：今日进行 103.7 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 2351 亿元 7 天期逆回购到期，当日实现净回笼 2247.3 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.85%，与上一交易日下降 5bp，3m shibor fixing: 1.8570%，与上一交易日下降 0.3bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.84%附近，后震荡下行成交在 1.84%-1.8275%区间附近，午盘报收 83/82.75。中午回来，5y repo 震荡成交在 1.83%-1.8225%区间附近，报收 82.5/82。1y repo 全天震荡成交在 1.7225%-1.715%区间附近，报收 72.25/71.75。

其他期限，2y repo 成交在 1.70%-1.7125%区间附近，3y repo 成交在 1.73%-1.735%区间附近。曲线方面，1x2y repo 成交在-1.25bp，2x5y repo 成交在-11.5bp 点位，1x2x5y 成交在-13bp 附近，1x5y repo 成交在 11bp-11.25bp 点位，报收 10.5/10.25。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 80/78.75，5y shibor 报收 89/88.25。曲线方面，1x5y shibor 报收 10.25/08.5。基差方面，1y basis 报收 08/07，5y basis 报收 07/06.25。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

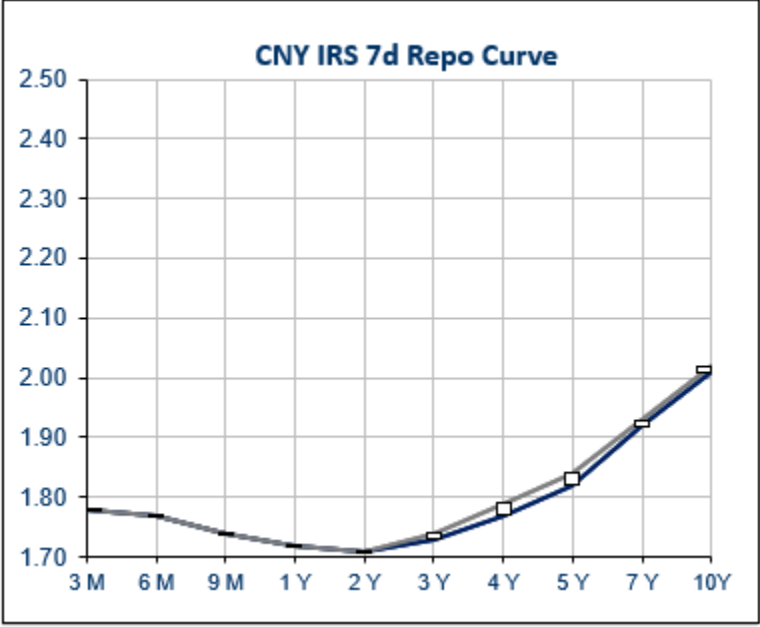
Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK
2024/8/1 Thursday

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	-				3 M	1.66	-2									
6 M	1.77	-	6 M	1.85	-	6 M	1.64	-2									
9 M	1.74	-	9 M	1.82	-1	9 M	1.63	-3									
1 Y	1.72	-	1 Y	1.79	-1	1 Y	1.75	-				1Y	1.71	-			
2 Y	1.71	-	2 Y	1.78	-1	2 Y	1.61	-1	2 Y	1.65	-	2Y	1.68	-1			
3 Y	1.73	-1	3 Y	1.8	-1	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.7	-1			
4 Y	1.77	-2	4 Y	1.84	-1				4 Y	1.8	-	4Y	1.75	-1			
5 Y	1.82	-2	5 Y	1.89	-1				5 Y	1.8	-	5Y	1.78	-1			
7 Y	1.92	-1	7 Y	1.98	-2				7 Y	1.8	-						
10Y	2.01	-1	10Y	2.07	-2				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.85	-5.00	3M Shibor	1.857	-0.30	O-N Shibor	1.608	-17.40	1Y DEPO	1.50							

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

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	-2	29	4	36
今日	-2	29	4	36



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:
以上所发及所加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国脉货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国脉货币”) 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、建议或诱导。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其所提供、对流动性或盈利性等需求, 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