



【2024-08-05】

中国央行今日进行 6.7 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率持平 1.7%。今日有 3015.7 亿元逆回购到期。资金面整体均衡。7d repo fixing: 1.80%，与上一交易日下降 2bp，3m shibor fixing: 1.8490%，与上一交易日下降 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.805%附近，后小幅震荡上行，成交在 1.805%-1.8175 %附近，午盘报收 81.75/81.25。中午回来，5y repo 先下行成交在 1.80%位置，后震荡上行，成交在 1.8025%-1.825%区间附近，报收 83/82.5。1y repo 全天随长端震荡成交在 1.7025%-1.725%区间附近，报收 73 /72.5。其他期限，2y repo 成交在 1.7075%-1.705%区间附近。曲线方面，2x5y repo 成交在 10.75bp 点位，1x5y repo 成交在 10-09.75bp 区间附近，报收 10.25/09.75。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 80.5/79，5y shibor 报收 90.5/89。曲线方面，1x5y shibor 报收 11.25/08.75。基差方面，1y basis 报收 07.5/06.5，5y basis 报收 07.5/06.5。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

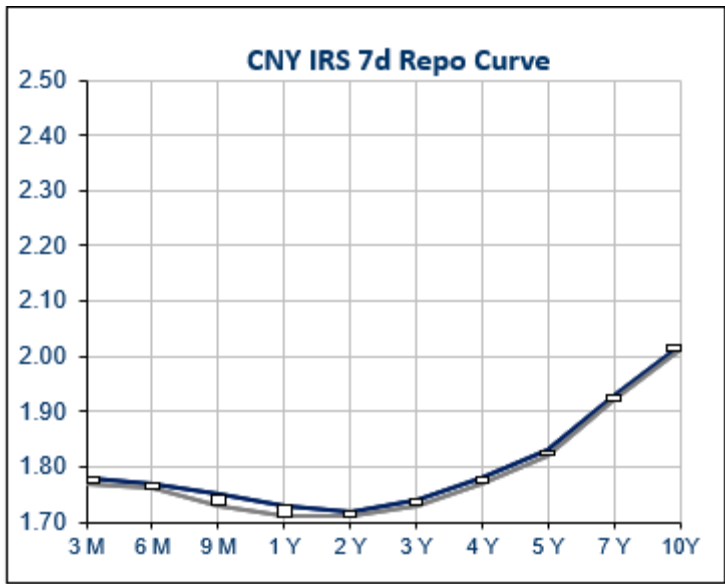
2024/8/5 Monday

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	1.65	-1						
6 M	1.77	1	6 M	1.85	-	6 M	1.63	-1						
9 M	1.75	2	9 M	1.82	-	9 M	1.65	2						
1 Y	1.73	2	1 Y	1.8	-	1 Y	1.75	13				1Y	1.72	1
2 Y	1.72	1	2 Y	1.79	-	2 Y	1.62	1	2 Y	1.65	-	2Y	1.68	-
3 Y	1.74	1	3 Y	1.8	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.69	-
4 Y	1.78	1	4 Y	1.85	1				4 Y	1.8	-	4Y	1.74	-
5 Y	1.83	1	5 Y	1.9	1				5 Y	1.8	-	5Y	1.77	-
7 Y	1.93	1	7 Y	1.99	2				7 Y	1.8	-			
10Y	2.02	1	10Y	2.06	-				10Y	1.8	-			
7D REPO	1.80	-2.00	3M Shibor	1.849	-0.40	0-N Shibor	1.585	1.20	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-1	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-2	1	-3	-				
9M*1Y	-2	-	-2	-	6M	8	-1	
1*2Y	-1	-1	-1	-	9M	7	-2	
1*3Y	1	-1	0	-	1Y	7	-2	
1*4Y	5	-1	5	1	2Y	7	-1	
1*5Y	10	-1	10	1	3Y	6	-1	
2*3Y	2	-	1	-	4Y	7	-	
2*4Y	6	-	6	1	5Y	7	-	
2*5Y	11	-	11	1				
3*4Y	4	-	5	1				
3*5Y	9	-	10	1				
4*5Y	5	-	5	-				
5*7Y	10	-	9	1				
5*10Y	19	-	16	-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	-3	28	3	36
今日	-4	28	2	34



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际货币经纪有限责任公司 (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改, 所有前述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang