



【2024-08-02】

中国央行今日开展 11.7 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率为 1.70%，与此前持平。因今日有 3580.5 亿元逆回购到期，当日实现净回笼 3568.80 亿元。中国央行本周共开展 7810.5 亿元逆回购操作，因本周共有 9847.5 亿元逆回购到期，本周实现净回笼 2037 亿元。资金面整体均衡偏松。7d repo fixing: 1.82%，与上一交易日下降 3bp，3m shibor fixing: 1.8530%，与上一交易日下降 0.4bp。

Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.8125%附近，后震荡下行成交在 1.8175%-1.805%区间附近，午盘报收 81/80.75。中午回来，5y repo 上行又回落震荡成交在 1.8075%-1.8325%区间附近，报收 81.75/81.25。1y repo 全天震荡成交在 1.705%-1.7225%区间附近，报收 71.75/71。其他期限，6m repo 成交在 1.75%-1.755%附近，9m repo 成交在 1.7225%-1.73%区间附近，2y repo 成交在 1.7125%附近。曲线方面，9mx1y repo 成交在-1.75bp。1x5y repo 成交在 10bp-10.25bp 点位，报收 10.25/10。

Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 80/79，5y shibor 报收 89.25/88。曲线方面，1x5y shibor 报收 10.25/08.25。基差方面，1y basis 报收 08.25/07.25，5y 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

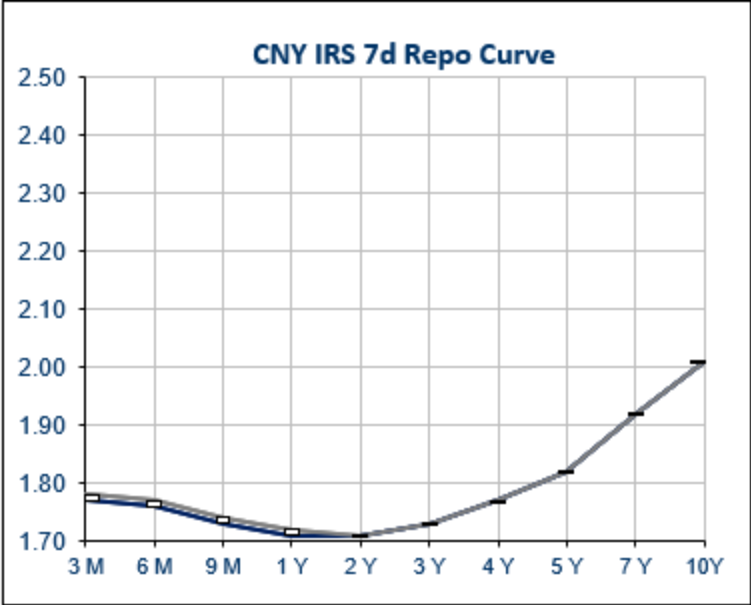
2024/8/2 Friday

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	Tenor	Mid	Δ bp
3 M	1.77	-1				3 M	1.66	-									
6 M	1.76	-1	6 M	1.85	-	6 M	1.64	-									
9 M	1.73	-1	9 M	1.82	-	9 M	1.63	-									
1 Y	1.71	-1	1 Y	1.8	1	1 Y	1.62	-13				1Y	1.71	-			
2 Y	1.71	-	2 Y	1.79	1	2 Y	1.61	-	2 Y	1.65	-	2Y	1.68	-			
3 Y	1.73	-	3 Y	1.8	-	3 Y	1.75	-	3 Y	1.77	-	3Y	1.69	-1			
4 Y	1.77	-	4 Y	1.84	-				4 Y	1.8	-	4Y	1.74	-1			
5 Y	1.82	-	5 Y	1.89	-				5 Y	1.8	-	5Y	1.77	-1			
7 Y	1.92	-	7 Y	1.97	-1				7 Y	1.8	-						
10Y	2.01	-	10Y	2.06	-1				10Y	1.8	-						
7D REPO	1.82	-3.00	3M Shibor	1.853	-0.40	0-N Shibor	1.573	-3.50	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO		
3M*6M	-1	-			Tenor	Mid	Δ bp	
6M*9M	-3	-	-3	-				
9M*1Y	-2	-	-2	1	6M	9	1	
1*2Y	0	1	-1	-	9M	9	1	
1*3Y	2	1	0	-1	1Y	9	2	
1*4Y	6	1	4	-1	2Y	8	1	
1*5Y	11	1	9	-1	3Y	7	-	
2*3Y	2	-	1	-1	4Y	7	-	
2*4Y	6	-	5	-1	5Y	7	-	
2*5Y	11	-	10	-1				
3*4Y	4	-	4	-				
3*5Y	9	-	9	-				
4*5Y	5	-	5	-				
5*7Y	10	-	8	-1				
5*10Y	19	-	17	-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	-3	28	3	36



联系人: Ruby Hu
邮箱: viaoting.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, 且为保密的利/或者专用的信息。其知识产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”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、股票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。所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

文 / Joyce Zhang