

收盘日评 银行间利率衍生品市场

宏观报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2021-04-23】

周五，中国央行今日开展 100 亿元逆回购操作，因今日有 100 亿元逆回购到期，当日实现零投放零回笼。资金面均衡，午后有所收紧，定盘上，3m shibor fixing: 2.6000%，较上一交易日持平。7d repo fixing: 2.12%，较上一交易日下跌 02bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交 2.90%，震荡成交在 2.895%至 2.905%区间，尾盘上行最高成交 2.92%，报收 92/91.5。1y repo 全天成交在 2.495%-2.515%区间，报收 52.25/51.5。2y repo 成交 2.62%位置附近，6m repo 成交 2.405%-2.41%区间，9m repo 成交 2.4625%-2.465%区间。曲线段，1x5y spd 成交在 39.75-40bp，6mx9m spd 成交 5.5bp，9mx1y spd 成交 3.5bp。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.88%-2.895%区间，5y shibor 成交 3.45%-3.455%区间。曲线端，1x5y spd 成交在 57bp 附近。Basis 端，1y 成交 38-38.5bp。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

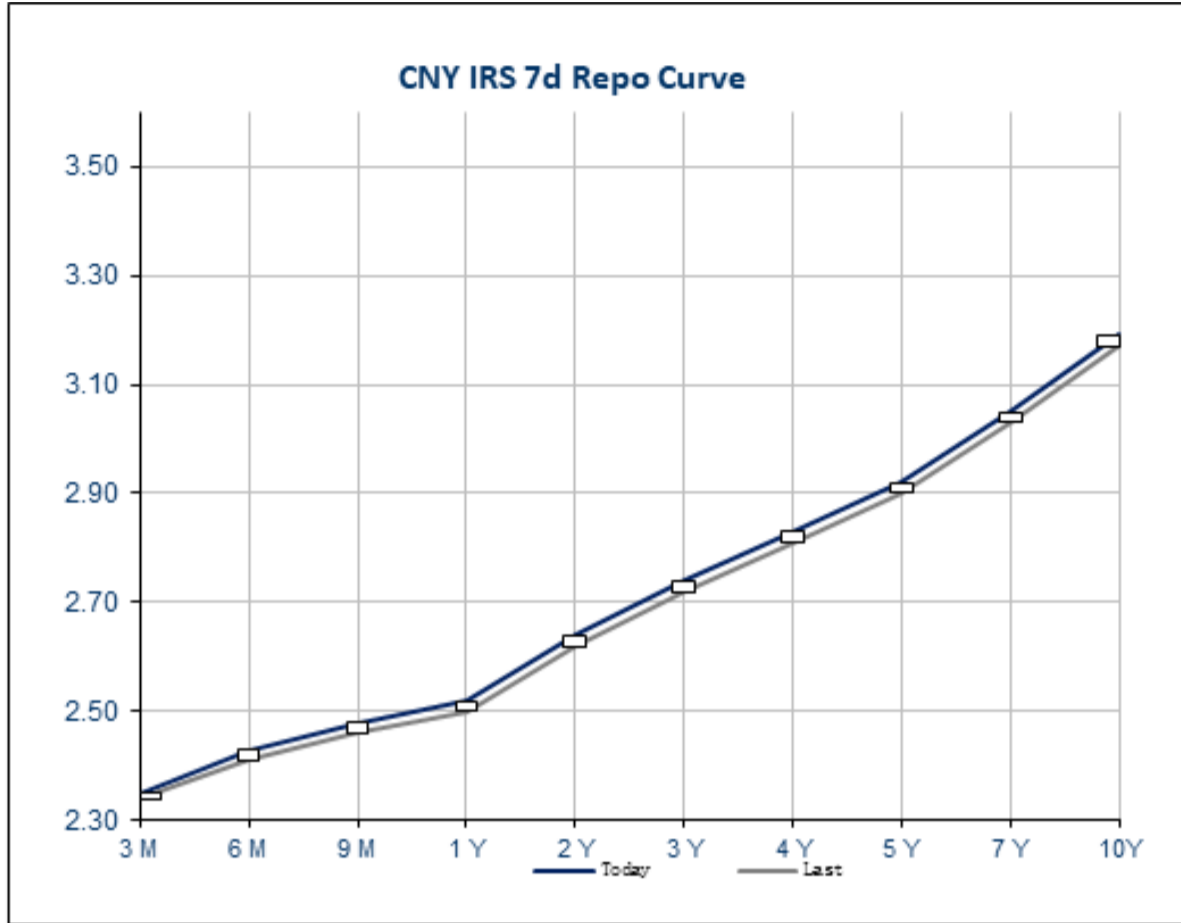
2021/4/23 星期五

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	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	2.35	1				3 M	2.18	-						
6 M	2.43	2	6 M	2.75	2	6 M	2.25	-						
9 M	2.48	2	9 M	2.83	2	9 M	2.28	-						
1 Y	2.52	2	1 Y	2.90	2	1 Y	2.29	-				1Y	2.46	1
2 Y	2.64	2	2 Y	3.08	2	2 Y	2.34	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.54	1
3 Y	2.74	2	3 Y	3.24	2	3 Y	2.39	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.64	1
4 Y	2.83	2	4 Y	3.36	2				4 Y	1.80	-	4Y	2.71	1
5 Y	2.92	2	5 Y	3.47	2				5 Y	1.80	-	5Y	2.76	1
7 Y	3.05	2	7 Y	3.62	2				7 Y	1.80	-			
10Y	3.19	2	10Y	3.79	2				10Y	1.80	-			
7D REPO	2.12	-2	3M Shibor	2.60	-	O-N Shibor	1.942	-18.50	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
					Tenor	Mid	Δbp
3M*6M	8	1					
6M*9M	5	-	8	-			
9M*1Y	4	-	7	-	6M	32	-
1*2Y	12	-	18	-	9M	35	-
1*3Y	22	-	34	-	1Y	38	-
1*4Y	31	-	46	-	2Y	44	-
1*5Y	40	-	57	-	3Y	50	-
2*3Y	10	-	16	-	4Y	53	-
2*4Y	19	-	28	-	5Y	55	-
2*5Y	28	-	39	-			
3*4Y	9	-	12	-			
3*5Y	18	-	23	-			
4*5Y	9	-	11	-			
5*7Y	13	-	15	-			
5*10Y	27	-	32	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	91	93	95	02	07	10	11
今日	91	93	95	02	07	10	11

Bond Swap	200008/5y repo	200013/5y repo	200014/3y repo	200016/5y repo	200210/5y repo	200215/5y repo
昨日	23	07	03	27	69	69
今日	21	04	00	25	67	67



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Wu
 邮箱: xiaoting.wu@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”) 仅供参考, 且为保密的、或有专权的、或知识产权属于上海国际期货经纪有限公司 (以下简称“上海期货”) 或其关联方。“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建议、定价、或投资建议。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其准确性、及时性或完整性, 且可能随时进行修订, 所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN