

收盘日评 银行间利率衍生品市场

完成报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd

【2021-04-22】

今日，央行公开市场开展 100 亿元 7 天期逆回购操作，有 100 亿元逆回购到期，实现零投放零回笼。资金面整体均衡。7d repo fixing: 2.14%，较上一交易日上升 04bp，3m shibor fixing: 2.6%，与上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 率先成交在 2.8975%，tkn 2.90% 后回落，之后反复成交在 2.90%-2.8975% 区间，午盘报收 90/89.75，中午回来，5y repo 成交 2.895% 后，一路 gvn 至 2.89% 位置附近，后震荡成交在 2.895%-2.8925%，报收 89.75/89.25。全天 1y repo 随长端震荡成交在 2.51%-2.4975% 区间，报收 50.25/50。3m repo 成交在 2.3425% 附近，6m repo 成交在 2.415%-2.4125% 附近，2y repo 成交在 2.6175%-2.62% 区间附近。曲线方面，3mx1y 成交在 16.5bp，6mx1y 成交在 09.25bp 附近，1x2y 成交在 12bp 附近，1x5y 成交在 39.25-39bp。

Shibor 端，1y shibor 成交在 2.885-2.8775% 附近，2y shibor 成交在 3.0625%-3.07% 区间，4y shibor 成交在 3.35% 附近，5y shibor 全天成交在 3.45% 附近。曲线方面，1x2y shibor 成交在 18.5-19bp，2x5y shibor 成交 38.5bp 位置附近。4x5y shibor 成交在 10bp 附近。基差方面，1y basis 成交在 37.75bp 附近，2y basis 成交在 44.5bp 附近，5y basis 成交在 55.5bp 附近。

其他方面，有所报价，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

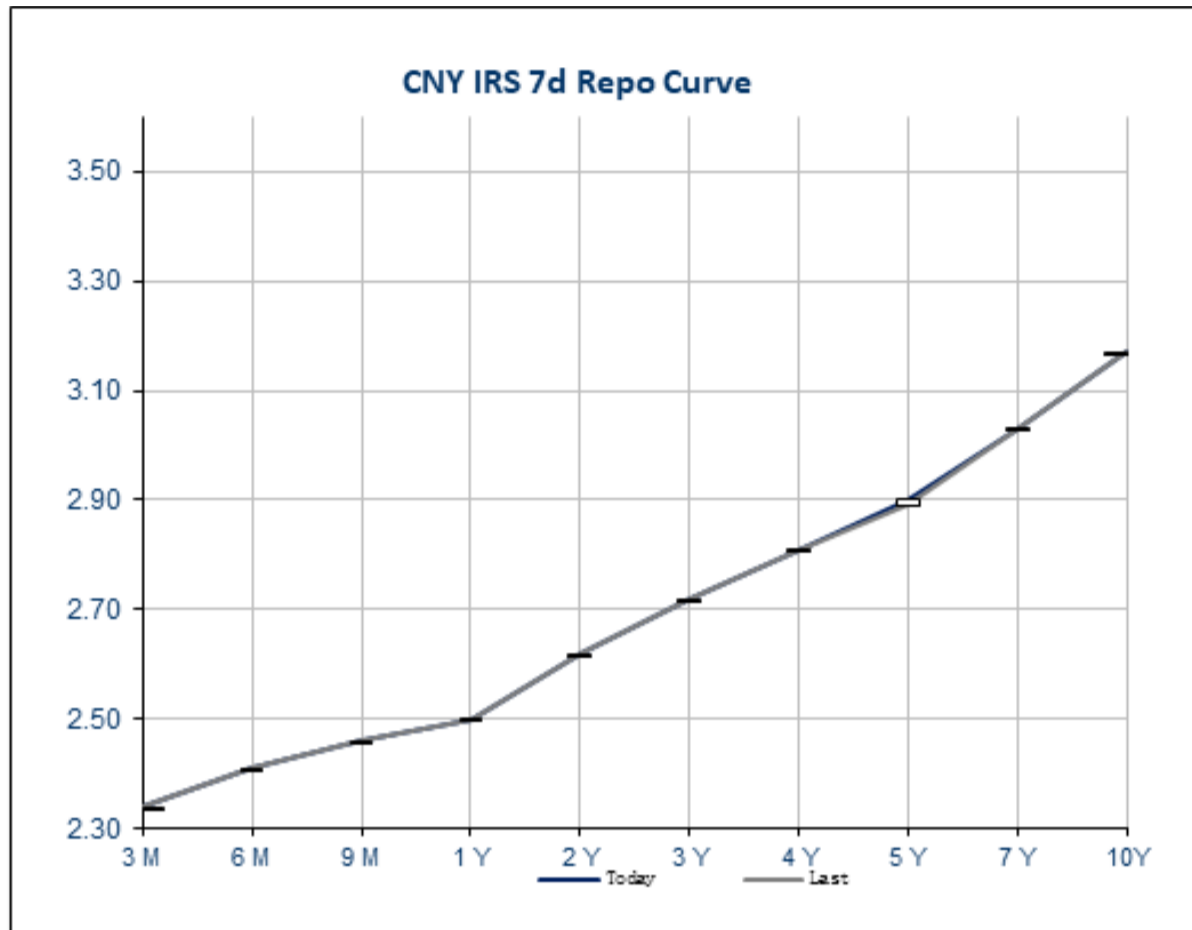
2021/4/22 星期四

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	2.34	-				3 M	2.18	-						
6 M	2.41	-	6 M	2.73	1	6 M	2.25	-						
9 M	2.46	-	9 M	2.81	1	9 M	2.28	-						
1 Y	2.50	-	1 Y	2.88	1	1 Y	2.29	-				1Y	2.45	-
2 Y	2.62	-	2 Y	3.06	-	2 Y	2.34	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.53	-
3 Y	2.72	-	3 Y	3.22	1	3 Y	2.39	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.63	1
4 Y	2.81	-	4 Y	3.34	1				4 Y	1.80	-	4Y	2.70	-
5 Y	2.90	1	5 Y	3.45	1				5 Y	1.80	-	5Y	2.75	1
7 Y	3.03	-	7 Y	3.6	1				7 Y	1.80	-			
10Y	3.17	-	10Y	3.77	1				10Y	1.80	-			
7D REPO	2.14	4	3M Shibor	2.60	-	O-N Shibor	2.127	26.30	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
					Tenor	Mid	Δbp
3M*6M	7	-					
6M*9M	5	-	8	-			
9M*1Y	4	-	7	-	6M	32	1
1*2Y	12	-	18	-1	9M	35	1
1*3Y	22	-	34	-	1Y	38	1
1*4Y	31	-	46	-	2Y	44	-
1*5Y	40	1	57	-	3Y	50	1
2*3Y	10	-	16	1	4Y	53	1
2*4Y	19	-	28	1	5Y	55	-
2*5Y	28	1	39	1			
3*4Y	9	-	12	-			
3*5Y	18	1	23	-			
4*5Y	9	1	11	-			
5*7Y	13	-1	15	-			
5*10Y	27	-1	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	22	06	03	26	69	68
今日	23	07	03	27	69	69



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Wu
 邮箱: vlouting_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:
 以上所登及附带的任何信息 (以下简称“信息”) 仅供参考, 不构成任何投资建议, 且为保密的或/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国信证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国信证券”) 或其三方, “信息”不能也不应被解释为任何金融工具、投资或任何交易策略相关的推介、定价、建议或需求, “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, 且可能随时进行修正, 所有陈述和保证均以明确免责声明为准。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN