



【2021-04-21】

央行公开市场今日进行 100 亿元人民币 7 天期逆回购操作。因今日有 100 亿元逆回购到期，当日实现零投放和零回笼。利率方面，7d repo fixing:2.10%，较上一交易日下行 12bp；3m shibor fixing: 2.6000%，较上一交易日持平。

Repo 端，5y repo 开盘 2.885%位置，5y repo 震荡成交 2.8825%-2.885%位置，后小幅回升，最高至 2.89%，报收 88.75/88.5。1y repo 震荡成交 2.495%-2.50%位置。午后，5y repo 震荡成交 2.8875%-2.8825%位置，报收 89/88.5。1y repo 成交 2.4975%位置左右，报收 50/49.5。

Shibor 端，5y shibor 成交 3.435%-3.4375%位置。1y shibor 成交 2.865%-2.8675%位置。2y shibor 成交 3.06%-3.0625%位置。曲线端，1x2y shibor spd 成交 19.25bp；1x5y shibor spd 成交 37bp；2x5y shibor spd 成交 37.75bp；1y s/r basis 成交 36.75bp-37bp；3y s/r basis 成交 49bp；5y s/r basis 成交 54.5bp。

LPR 端，9m lpr agst 1Y 成交 3.925%位置。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

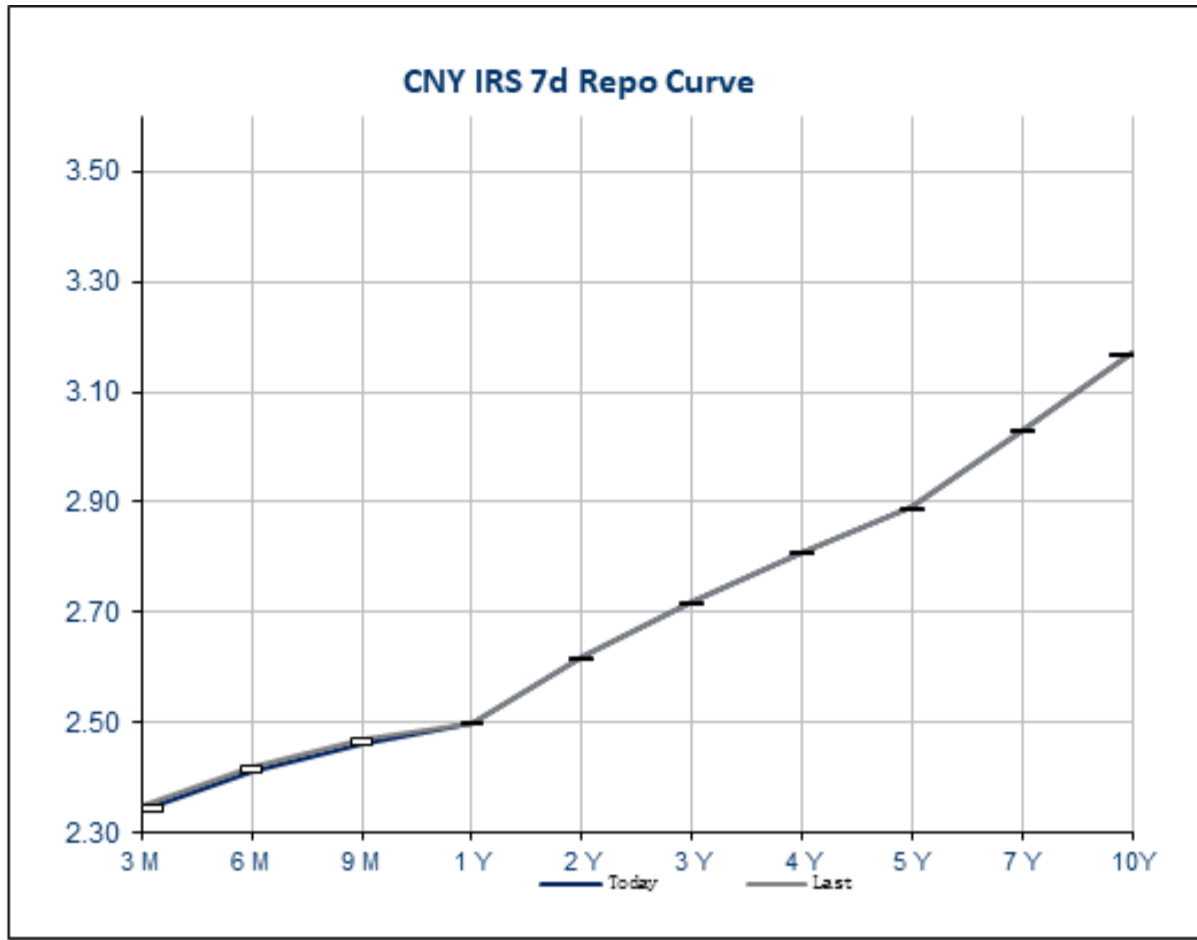
2021/4/21 星期三

Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd														
ONSHORE IRS									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	-1				3 M	2.18	-						
6 M	2.41	-1	6 M	2.72	-	6 M	2.25	-						
9 M	2.46	-1	9 M	2.80	-	9 M	2.28	-						
1 Y	2.50	-	1 Y	2.87	-	1 Y	2.29	-				1Y	2.45	1
2 Y	2.62	-	2 Y	3.06	-	2 Y	2.34	-	2 Y	1.65	-	2Y	2.53	1
3 Y	2.72	-	3 Y	3.21	-	3 Y	2.39	-	3 Y	1.77	-	3Y	2.62	1
4 Y	2.81	-	4 Y	3.33	-				4 Y	1.80	-	4Y	2.70	2
5 Y	2.89	-	5 Y	3.44	1				5 Y	1.80	-	5Y	2.74	2
7 Y	3.03	-	7 Y	3.59	-				7 Y	1.80	-			
10Y	3.17	-	10Y	3.76	-				10Y	1.80	-			
7D REPO	2.10	-12	3M Shibor	2.60	-	O-N Shibor	1.864	1.00	1Y DEPO	1.50				

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
					Tenor	Mid	Δbp
3M*6M	7	-					
6M*9M	5	-	8	-			
9M*1Y	4	1	7	-	6M	31	1
1*2Y	12	-	19	-	9M	34	1
1*3Y	22	-	34	-	1Y	37	-
1*4Y	31	-	46	-	2Y	44	-
1*5Y	39	-	57	1	3Y	49	-
2*3Y	10	-	15	-	4Y	52	-
2*4Y	19	-	27	-	5Y	55	1
2*5Y	27	-	38	1			
3*4Y	9	-	12	-			
3*5Y	17	-	23	1			
4*5Y	8	-	11	1			
5*7Y	14	-	15	-1			
5*10Y	28	-	32	-1			

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	04	26	69	68
今日	22	06	03	26	69	68



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Hu
 邮箱: huoqing.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:
 以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅供参考, 且为保密的或/或者专有的信息, 其知识产权属于上海国融证券经纪有限责任公司 (以下简称“上海国融证券”) 或其三方。“信息”不应当也不应被解释为任何金融工具、投资建议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, 所有陈述和保证均以明确免责声明为准。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN