



**【2021-05-14】**

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。定盘上，3m shibor fixing: 2.5210%，较上一交易日下跌 0.40bp。7d repo fixing: 2.05%，较上一交易日下跌 02bp。

Repo 端，5y repo 开盘成交 2.885%，全天窄幅震荡，成交在 2.8775%-2.8925% 区间，尾盘高位报收 89.5/89，1y repo 成交在 2.48%-2.4725%，报收 48.25/47.75。3m repo 成交 2.2975%-2.305%，2y repo 成交 2.595%-2.6025%。曲线端略微走陡，1x5y repo spd 成交 40.25-41.25bp，1x2y repo spd 成交 12.75bp。

Shibor 端，1y shibor 成交 2.82%-2.8275%，5y shibor 成交 3.3875%-3.3925%。

其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

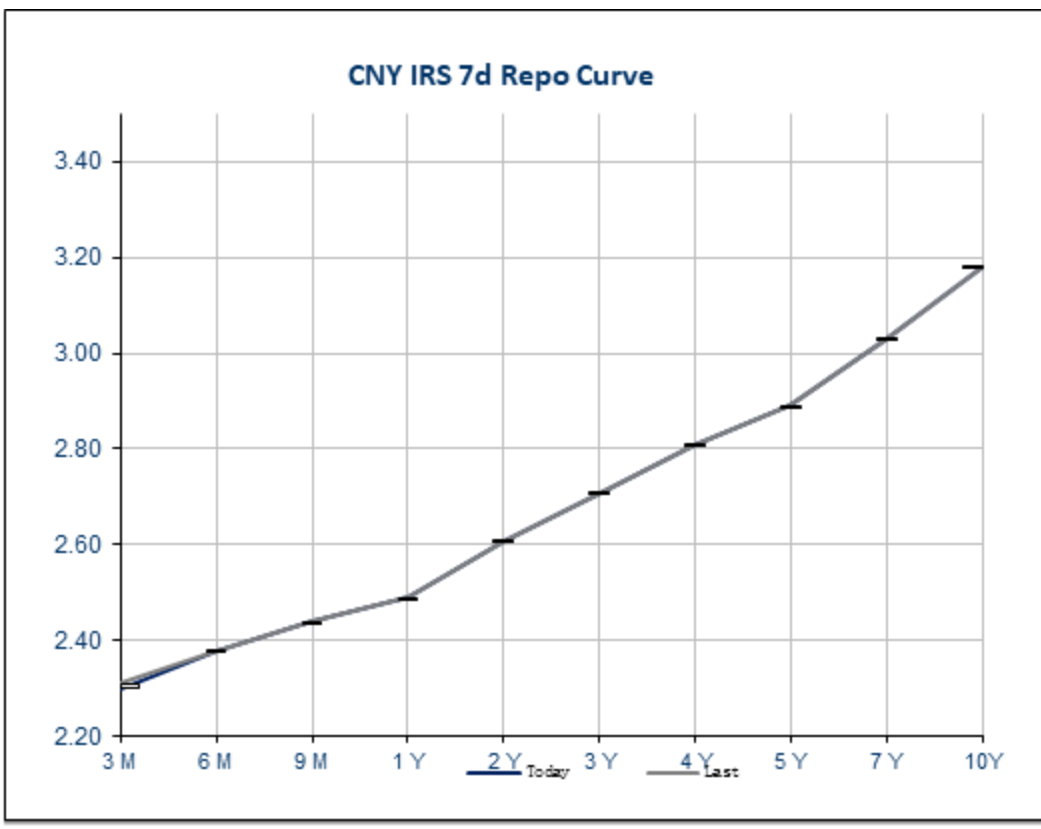
2021/5/14 星期五

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	Tenor	Mid	Δbp									
3 M	2.30	-1				3 M	2.18	-																		
6 M	2.38	-	6 M	2.67	-	6 M	2.25	-																		
9 M	2.44	-	9 M	2.77	-	9 M	2.28	-																		
1 Y	2.49	-	1 Y	2.83	-	1 Y	2.29	-							1Y	2.41	-1									
2 Y	2.61	-	2 Y	3.01	-	2 Y	2.34	-				2 Y	1.65	-	2Y	2.50	-1									
3 Y	2.71	-	3 Y	3.16	-	3 Y	2.39	-				3 Y	1.77	-	3Y	2.60	-									
4 Y	2.81	-	4 Y	3.29	-							4 Y	1.80	-	4Y	2.68	-									
5 Y	2.89	-	5 Y	3.40	-							5 Y	1.80	-	5Y	2.73	-									
7 Y	3.03	-	7 Y	3.57	-							7 Y	1.80	-												
10Y	3.18	-	10Y	3.74	-							10Y	1.80	-												
7D REPO	2.05	-2	3M Shibor	2.521	-0.40	O-N Shibor	1.805	-16.10	1Y DEPO	1.50																

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
					Tenor	Mid	Δbp
3M*6M	8	1					
6M*9M	6	-	10	-			
9M*1Y	5	-	6	-	6M	29	-
1*2Y	12	-	18	-	9M	33	-
1*3Y	22	-	33	-	1Y	34	-
1*4Y	32	-	46	-	2Y	40	-
1*5Y	40	-	57	-	3Y	45	-
2*3Y	10	-	15	-	4Y	48	-
2*4Y	20	-	28	-	5Y	51	-
2*5Y	28	-	39	-			
3*4Y	10	-	13	-			
3*5Y	18	-	24	-			
4*5Y	8	-	11	-			
5*7Y	14	-	17	-			
5*10Y	29	-	34	-			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	91	93	94	01	06	09	11
今日	91	93	94	01	06	09	11

Bond Swap	200008/5y repo	200013/5y repo	200014/3y repo	200016/5y repo	210205/5y repo	200215/5y repo
昨日	19	04	00	24	64	69
今日	19	04	00	25	65	69



文 / Joyce Zhang

联系人: Ruby Bu  
 邮箱: xiaoting.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:**

以上所发及附送的所有信息 (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、出价、建议或请求, “信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、时效性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改, 所有前述的保证均经明确免责声明。

**WWW.CFETS-NEX.COM.CN**