

收盘日评 银行间票据市场

常规报告系列

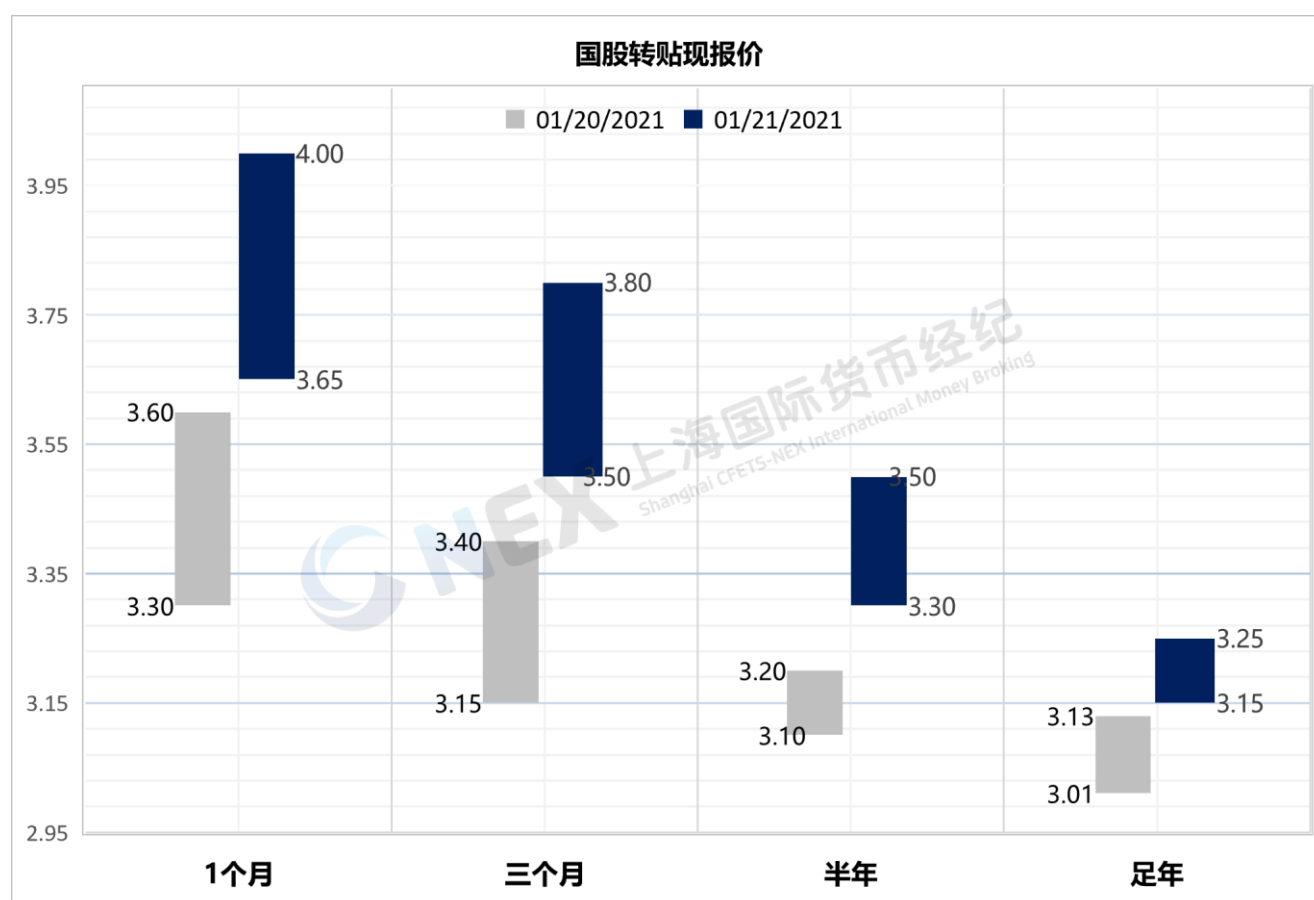
NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2021-01-21】

今日央行公开市场进行 2500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，资金净投放 2480 亿。受票据供给量大增影响，本交易各期限票据供大于求态势持续递延，利率价格较昨日上涨明显。

本交易日一季度双国股方面，卖盘供给依旧积极出票，买方需求则寥寥无几，早盘询价利率 3.65% 附近，随后一路走高，午盘后成交在 4.00% 附近，全天报价位于 3.65%~4.00% 左右；二季度双国股早盘询价在 3.50%~3.60% 左右，午盘后一路走高至 3.80% 附近，较昨日上涨明显；三季度双国股买盘收票积极，但由于供给强盛，价格走高至 3.30%~3.50% 附近；足年双国股方面早盘买盘机构逐步建仓，市场交投活跃，市场询价在 3.15%~3.20% 位置，午盘后震荡上行至 3.25% 左右，临近尾盘随着收口增多，价格又回调至 3.20% 附近，日内整体询价位于 3.15%~3.25% 附近。

本交易日，国股银票转贴现利率：1 个月 3.67%，3 个月 3.47%，6 个月 3.36%，9 个月 3.27%，一年 3.21%；城商银票为：1 个月 3.91%，3 个月 3.77%，6 个月 3.67%，9 个月 3.48%，一年 3.28%。



2021/01/21 票交所利率曲线 (%)

期限	国股	城商
1D	1.75	2.00
7D	1.75	2.00
1M	3.67	3.91
3M	3.47	3.77
6M	3.36	3.67
9M	3.27	3.48
1Y	3.21	3.28

2021/01/20 票交所市场数据 (亿)

	本日	较昨日	本月累计	本年累计
承兑量	1156.92	58.66	14444.68	14444.68
贴现量	765.87	43.71	10056.04	10056.04
交易量	2935.83	-76.59	43167.96	43167.96

2021/01/21 同期限存单与票据利率关系 (%)

期限	AAA+ 股份制存单	票据与存单差额	
1Y	2.86	+35	BP

文\Diana Wang

联系人: Elaine Zhu
 邮箱: Elaine.Zhu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所含及附加的所有信息(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报价、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。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN