

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

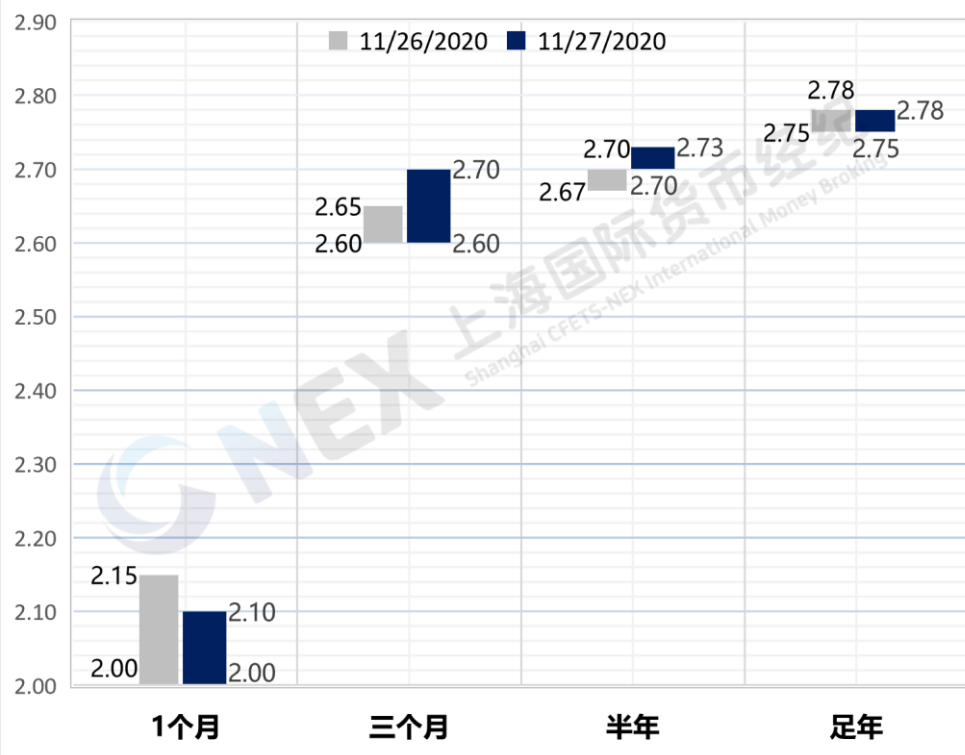
【2020-11-27】

今日央行 omo 开展了 1200 亿元逆回购操作，逆回购到期 800 亿元，净投放 400 亿元。临近月末，票据转贴现市场交投活跃，市场各机构平规模需求较多，由于上半周多数买方基本平盘，本交易日各期限利率略有反弹。

本交易日，12 月双国股市场利率略有收窄，全天位于 2.00%~2.10% 区间；一季度双国股早盘交投活跃，利率区间位于 2.62%~2.65% 左右，随着买方陆续平盘，午盘过后利率有所回升，全天报价位于 2.62%~2.70% 区间；二季度双国股整体供大于求，早盘利率位于 2.70% 左右，午盘过后利率上行至 2.73% 附近，全天报价区间位于 2.70%~2.73% 左右；三季度双国股买卖双方相对冷清，整体报价位于 2.72%~2.75%；足年双国股买卖双方交投活跃，成交价格保持稳定，全天报价区间位于 2.75%~2.78%。

本交易日，国股银票转贴现利率：1 个月 2.06%，3 个月 2.66%，6 个月 2.70%，9 个月 2.75%，一年 2.77%；城商银票为：1 个月 2.10%，3 个月 2.82%，6 个月 2.86%，9 个月 2.88%，一年 2.95%。

国股转贴现报价



2020/11/26 票交所市场数据 (亿)

	本日	较昨日	本月累计	本年累计
承兑量	1306.83	196.92	13965.05	192720.45
贴现量	585.02	56.50	8417.52	118411.04
交易量	2727.45	184.63	41361.17	571270.98

2020/11/27 票交所利率曲线 (%)

期限	国股	城商
1D	2.20	2.30
7D	2.03	2.13
1M	2.06	2.10
3M	2.66	2.82
6M	2.70	2.86
9M	2.75	2.88
1Y	2.77	2.95

2020/11/27 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	3.34	-57 BP

文 Ivan 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:

以上所登及附加的所有信息 (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