

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

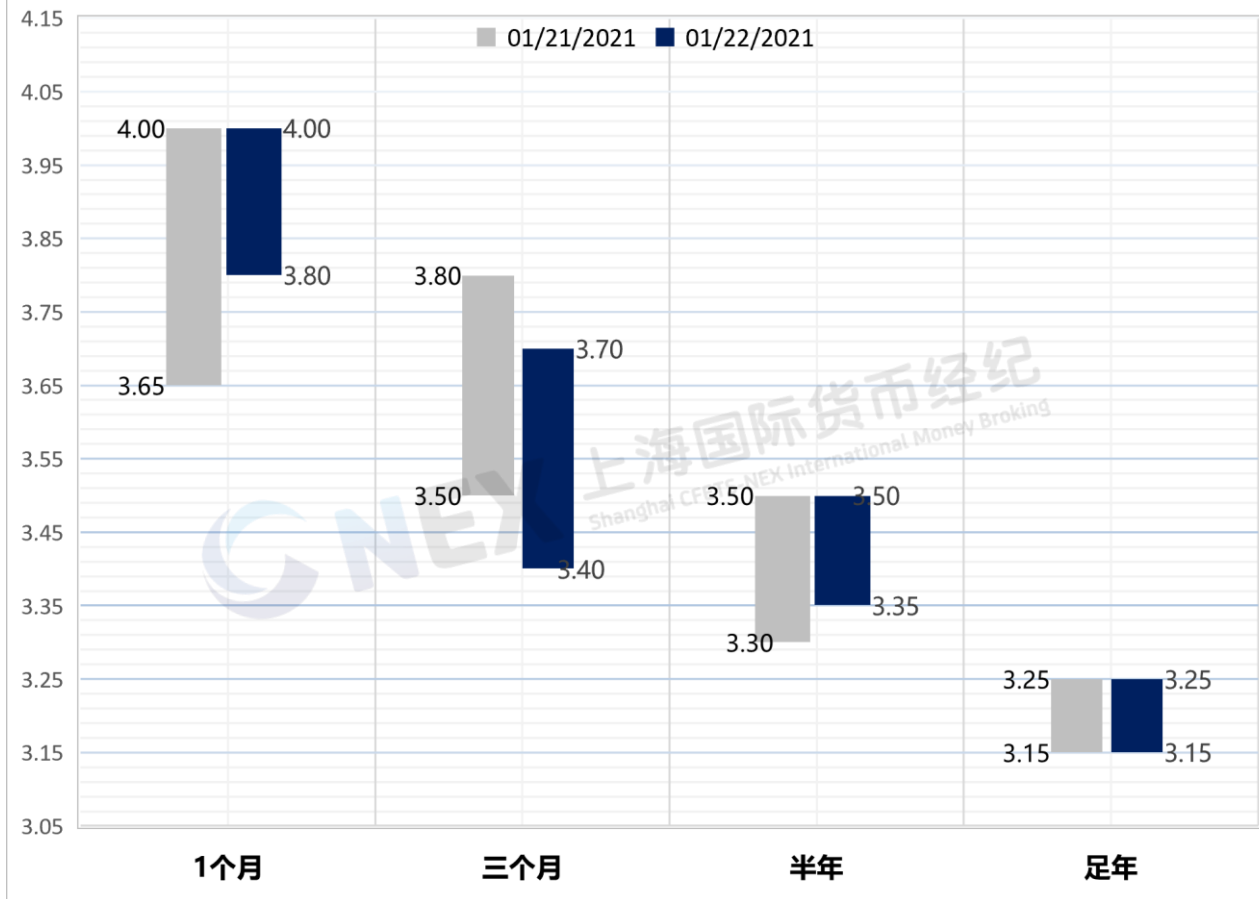
【2021-01-22】

今日央行公开市场进行 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，资金零投放零回笼。受昨日利率下行情绪影响，本交易日各期限票据品报价有不同幅度走低，长期需求量增加，供给方出票则相对谨慎。

一季度双国股方面，早盘卖方供给依旧活跃，买方需求较前一交易日略有增多，早盘询价利率位于 3.90~4.00% 附近，午盘后利率有所回调，询价区间位于在 3.75%~3.90%，全天报价位于 3.75%~4.00% 左右；二季度双国股早盘询价位于 3.55%~3.70% 区间，随着买盘报价增多，利率下行至 3.40%~3.65% 附近，较昨日有明显下行；三季度双国股供给方有所减少，询价利率走低，全天报价位于 3.35%~3.50% 附近；足年双国股方面，市场延续昨日下午趋势，买盘机构明显增多，市场整体供不应求，早盘买卖双方对价格分歧较大，询价区间位于 3.20%~3.25% 附近，临近午盘已稳定在 3.18%~3.19% 位置，午盘过后利率下探至 3.15% 左右，全天报价位于 3.15%~3.25% 附近。

本交易日，国股银票转贴现利率：1 个月 3.95%，3 个月 3.62%，6 个月 3.48%，9 个月 3.28%，一年 3.28%；城商银票为：1 个月 4.03%，3 个月 3.88%，6 个月 3.64%，9 个月 3.52%，一年 3.40%。

国股转贴现报价



2021/01/21 票交所市场数据 (亿)

	本日	较昨日	本月累计	本年累计
承兑量	1140.87	-16.05	15585.56	15585.56
贴现量	617.57	-148.30	10673.61	10673.61
交易量	2857.14	-78.69	46025.11	46025.11

2021/01/22 票交所利率曲线 (%)

期限	国股	城商
1D	1.82	2.02
7D	1.82	2.02
1M	3.95	4.03
3M	3.62	3.88
6M	3.48	3.64

9M	3.28	3.52
1Y	3.28	3.40

2021/01/22 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	2.89	+39 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