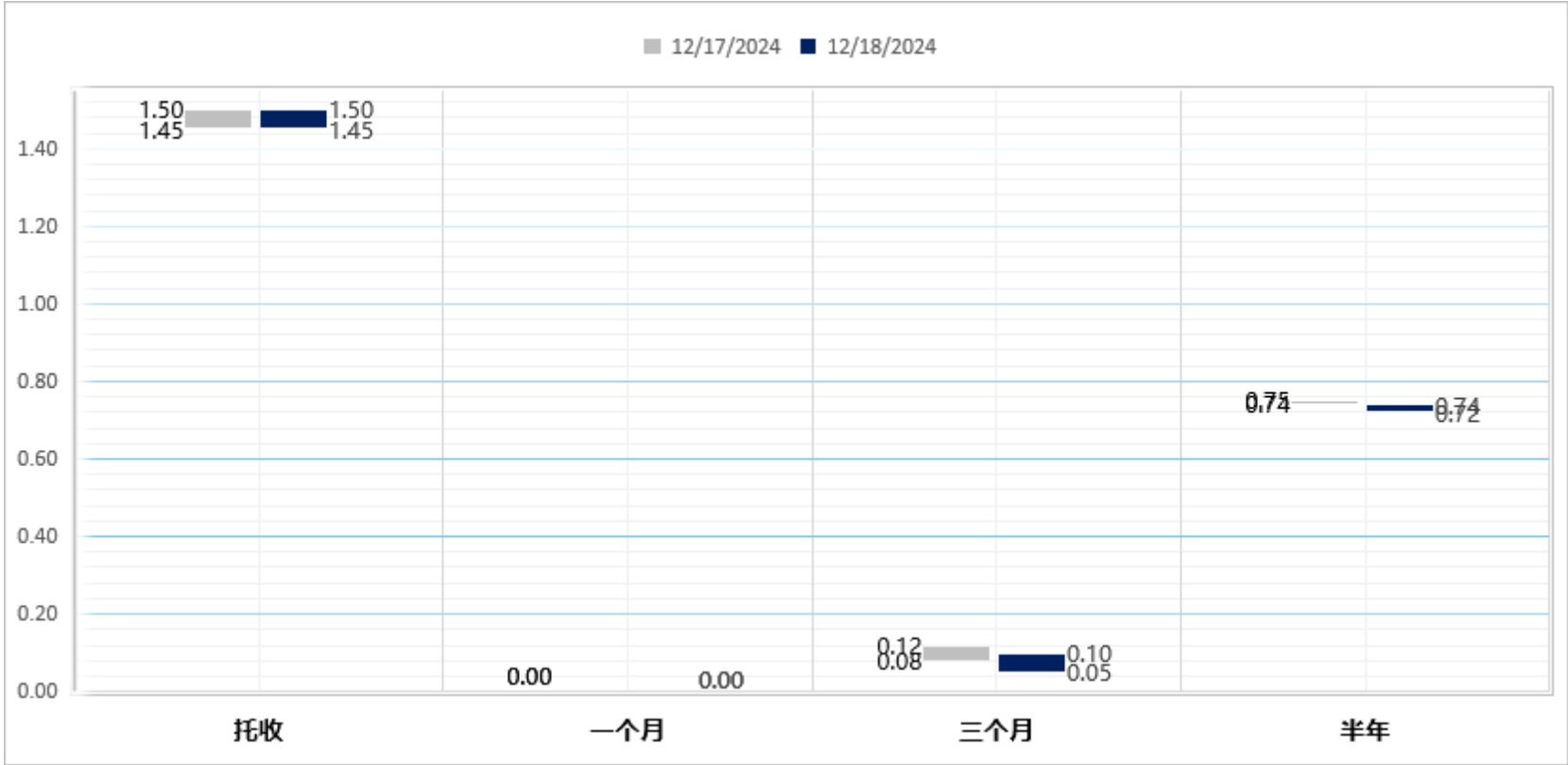




【2024-12-18】

今日央行开展 3876 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 786 亿，逆回购口径资金净投放 3090 亿。今日资金面开盘均衡偏紧，尾盘趋于均衡偏松，短期限资金价格下行。今日票据转贴现市场交投活跃，一季度到期票据买盘需求旺盛，利率持续下行，一票难询，二月国股利率维持低点 0.01%，三月票最低降至 0.05%附近，午盘后供给有所释放，利率小幅回弹。二季度到期票早盘买卖双方拉锯，随主流机构入场，日内小幅震荡。

托收方面，全天报价区间多在 1.45%~1.50%附近。一季度方面，1 月到期一票难求，始终维持在低利率区间，整体报价在 0.0001%附近；2 月双国全天报价区间多在 0.01%~0.02%；3 月双国全天报价区间多在 0.05%~0.10%。二季度方面，4 月双国全天报价区间多在 0.73%~0.75%；5 月双国全天报价区间多在 0.82%~0.84%，6 月国股全天报价区间多在 0.72%~0.74%。



Thanks & Best Regards

徐锐祥 Rui

票据市场部 Commercial Paper Market

上海市杨浦区荆州路 27 号（200082）
27 Jingzhou Road, Yangpu District, Shanghai (200082)
Phone: 86-21-68983627 | Mobile: 86-15921538983 | Fax: 86-21-50472092 | Email: ivan.wang@cfets-nex.com.cn
Website: www.cfets-nex.com.cn

