

收盘日评 银行间票据业务

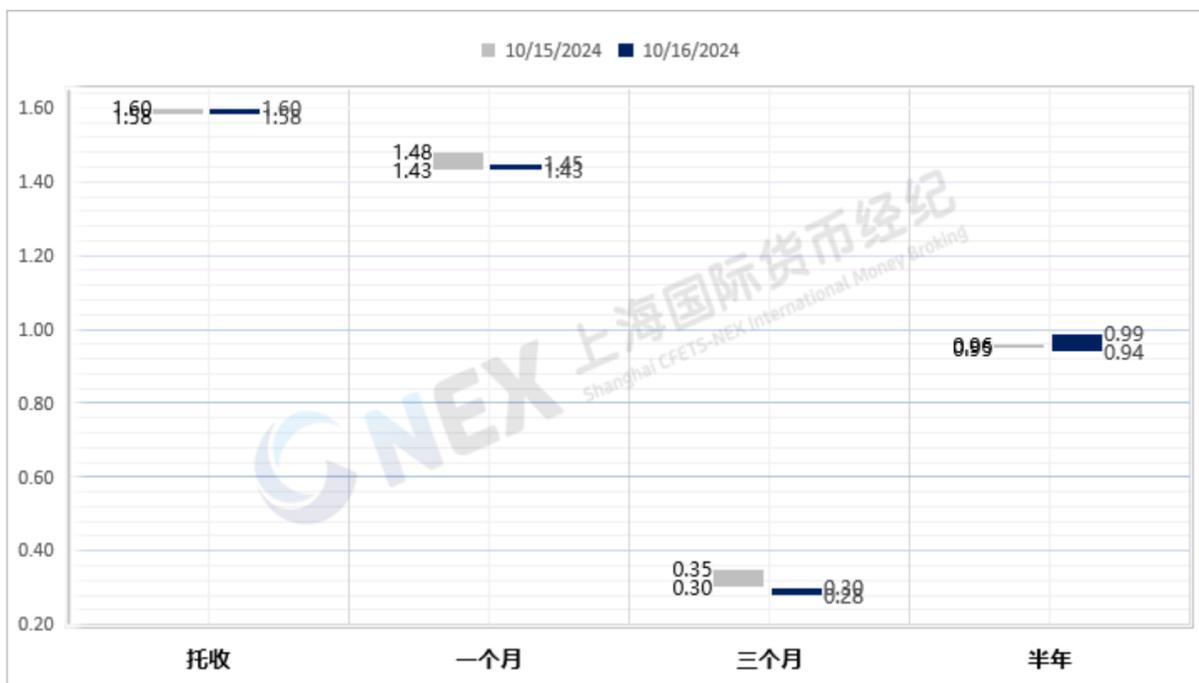
常规报告系列



【2024-10-16】

今日央行开展 6424 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 610 亿，MLF 到期 7890 亿，全口径资金净回笼 2076 亿。今日资金面整体均衡，尾盘均衡偏松，短期限资金价格上行。本交易日票据转贴现利率日内止跌回升，其中一季度票出现拐点反弹明显。

托收国股方面，全天报价区间多在 1.58%~1.60%。年内国股方面，开盘微跌午后回调，11 月国股全天报价区间多在 1.43%~1.45%。12 月国股全天报价区间多在 1.36%~1.38%。跨年国股方面，除 1 月票外，其余各期限利率尾盘大幅上扬，1 月、2 月、3 月和 4 月到期国股分别收盘于 0.30%、0.85%、0.76%和 0.99%。整体来看 1 月国股全天利率稳定在 0.28%~0.30%。2 月国股全天报价区间多在 0.80%~0.85%。3 月国股全天报价多在 0.72%~0.76%。4 月国股全天报价区间多在 0.94%~0.99%。



文：Amber Zhang

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:
以上所念及附加的所有信息 (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