

# 收盘日评 银行间票据业务

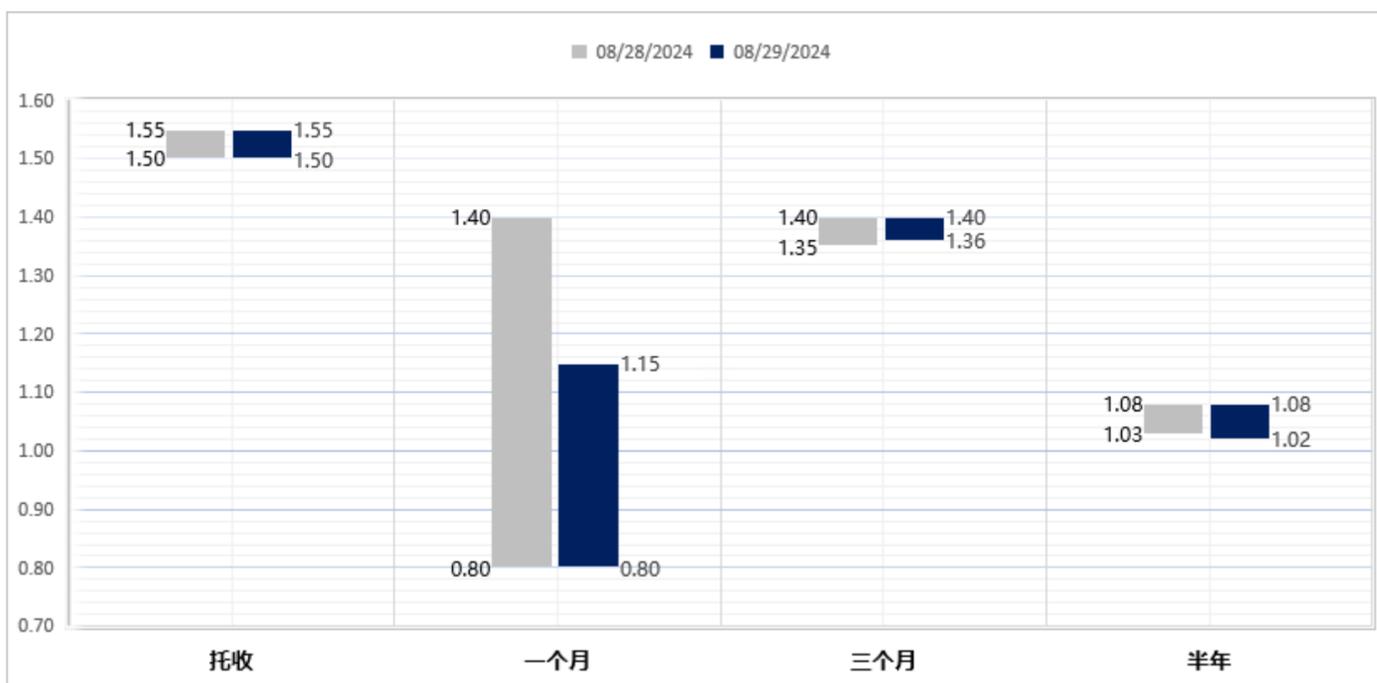
常规报告系列



【2024-08-29】

今日央行开展 1509 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3593 亿，全口径资金净回笼 2084 亿。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格继续下行。本交易日票据转贴现市场交投活跃，临近月末各机构规模逐渐平盘，年内及跨年需求抬头，利率较昨日有小幅下行，午盘过后各期限利率又有小幅下探。

价格方面，托收报价区间维持在 1.50%~1.55% 之间。9 月国股方面，本交易日利率日内下行，月初到期票位于 0.80%~0.90% 左右，整体位于 0.80%~1.15% 区间。四季度方面，10~11 月报价位于 1.36%~1.43%，12 月到期国股买盘需求旺盛，市场整体报价区间在 1.35%~1.40% 左右。跨年到期票方面，1 月国股早盘受市场影响利率开始下行，早盘报价位于 0.80%~0.83%，午盘后利率大幅回调，全天报价区间在 0.72%~0.83%；2 月国股早间开盘主流机构积极收票，利率位于 1.07%~1.08% 左右，随着需求不断涌现，利率下探至 1.02%~1.03% 附近，全天报价区间位于 1.02%~1.09%。



Thanks & Best Regards

王成 Ivan

专家经纪人 Expert Broker | 票据市场部 Commercial Paper Market