

常规报告系列



收盘日评 银行间票据业务



【2024-12-13】

今日央行开展 2051 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1909 亿，逆回购口径资金净投放 142 亿。今日资金面整体均衡偏紧，尾盘趋于均衡，隔夜期限资金价格小幅下行。今日票据转贴现市场交投活跃，一季度到期票据依旧紧俏，利率较昨日有所下行。二季度到期票早盘受市场主流机构降价收票影响，利率继续回调，6M 双国于 0.72%附近企稳横盘。

托收方面，全天报价区间多在 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 0.05%~0.10%；3 月双国全天报价区间多在 0.12%~0.17%。二季度方面，4 月双国全天报价区间多在 0.75%~0.76%；5 月双国全天报价区间多在 0.81%~0.85%，6 月国股全天报价区间多在 0.72%~0.75%。

