

收盘日评 银行间票据业务

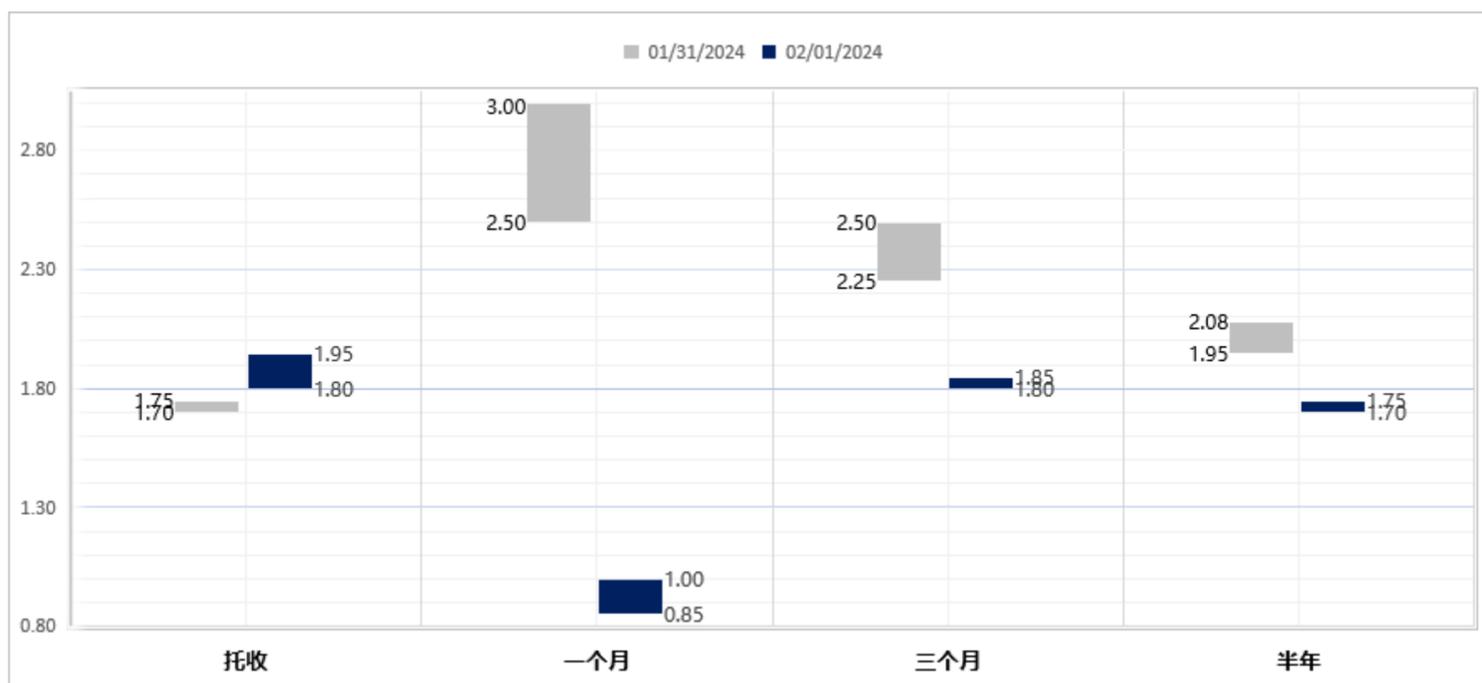
常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-02-01】

今日央行开展 430 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4660 亿，全口径资金净回笼 4230 亿。今日资金面总体维持均衡附近波动，日内稍有收敛，短期限资金价格小幅下行。月初托收交易旺盛，卖方以非银机构为主要力量，买方以银行机构为主要力量。其他各期限国股利率较上月底均出现断崖式下行，其中以三月国股最甚。

托收方面，全天供给充足，非银机构为出票主力，早盘成交价在 1.80% 附近，由于票源不断，日内单边上行，尾盘在 1.93%~1.95% 之间维稳，全天报价位于 1.80%~1.95%。三月双国股供不应求，各家机构方向高度一致，导致三月双国股一票难求，一度突破 1.0 大关，全天报价位于 0.85%~1.0%。二季度双国股方面，四月双国早盘在 1.90% 附近，需求较少，日内出现上行，全天报价位于 1.90%~1.95%。五月双国股早盘报价位于 1.80% 附近，全天报价位于 1.80%~1.85% 之间。六月双国股市场需求持续旺盛，票源较少，早盘报价区间位于 1.66%~1.67% 之间，全天利率单边下行，尾盘降至 1.60% 附近，全天报价位于 1.60%~1.67%。足月双国股方面，较上月底同样出现大幅下行，开盘报在 1.75% 附近但难以成交，随后买盘让步，逐步下降至 1.70% 附近，全天报价位于 1.70%~1.75%。



文: Rui Xu

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