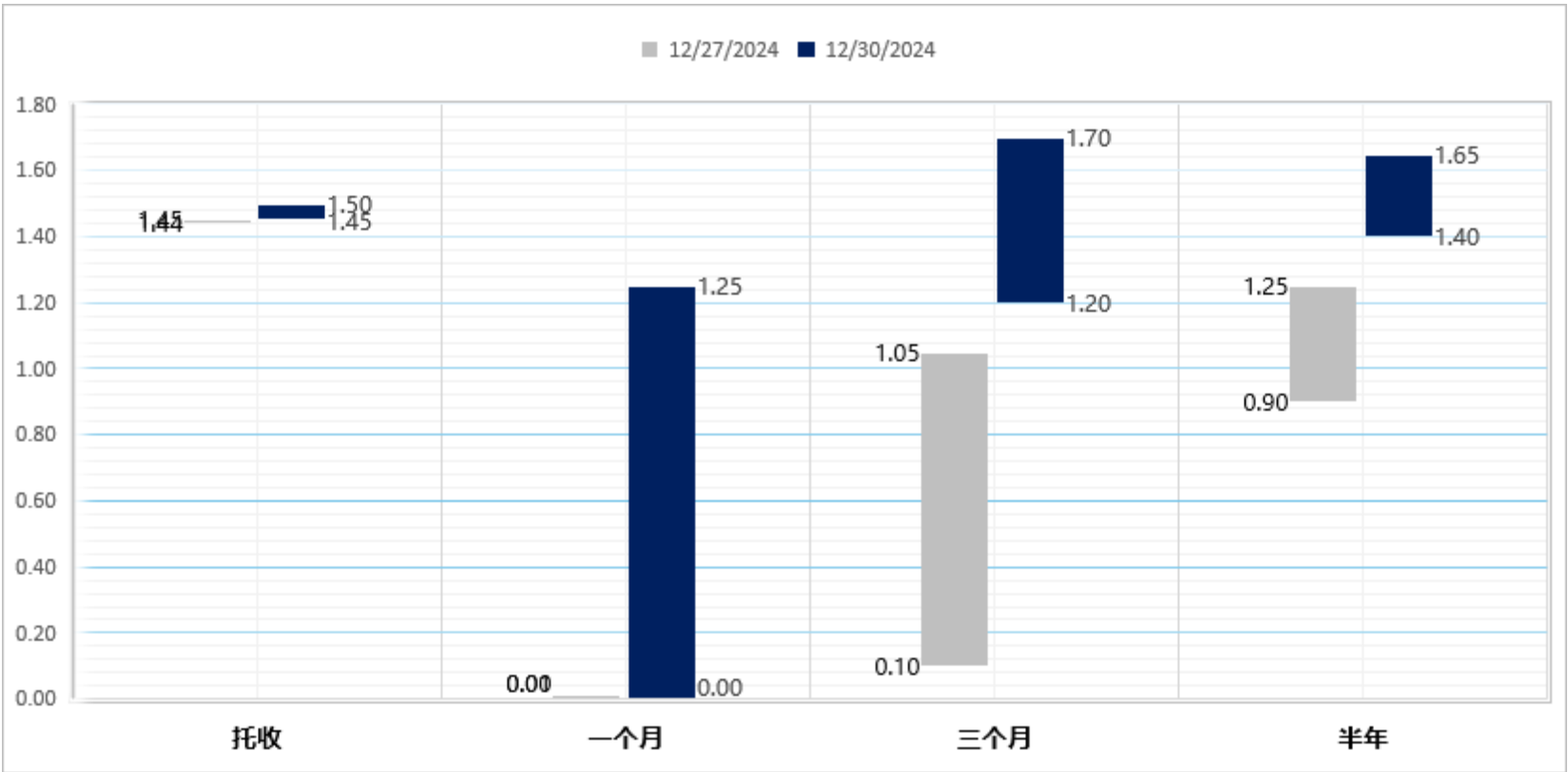




【2024-12-30】

今日央行开展 891 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1096 亿，逆回购口径资金净回笼 205 亿。今日资金面早盘偏紧，午后趋于改善，尾盘均衡，短期限资金价格维持波动。临近月末，市场波动较大，开盘整体出票力量强势，买盘规模压缩，整体利率大幅上行。部分交易盘着手建仓，足月国股涨至高点后小幅下滑，随后全天维持稳定。

一季度方面，供给充足，利率上行明显。1 月全天报价在 1.0%~1.25% 附近；2 月双国在 1.10%~1.70%；3 月双国全天报价区间多在 1.20%~1.70%。二季度方面，4 月双国全天报价区间多在 1.35%~1.70%；5 月双国全天报价区间多在 1.35%~1.65%，6 月双国全天报价区间多在 1.40%~1.65%。



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

