

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 CPETS NEX International Money Broking

【2024-11-22】

今日央行开展 6351 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 9810 亿，逆回购口径资金净回笼 3459 亿。今日资金面早盘均衡，尾盘均衡偏紧，隔夜期限资金价格上行。今日票据转贴市场卖方力量较强，各期限票据仍延续昨日尾盘呈上行态势，短期票利率上行明显。足月国股供给充足，4、5 月国股买卖盘拉扯，全天利率小幅波动。

托收国股方面，全天报价区间多在 1.35%~1.40%。年内国股方面，12 月国股利率较上个交易日上行明显，全天报价区间为 0.70%~0.80%。跨年国股方面，1 月票利率依旧维持低位运行，全天报价区间在 0.001%~0.001%。2 月国股全天报价区间位于 0.13%~0.18%。3 月国股全天报价区间多在 0.15%~0.20%。4~5 月双国股价格受期限影响，拉开价差，4 月双国股利率全天报价区间为 0.65%~0.66%，5 月双国股利率全天报价区间为 0.68%~0.70%。

